

Instituto Superior de Economia e Gestão (ISEG)
Universidade de Lisboa

Econometria, 2018–2019, 1^o semestre

Programa

- **1^a Parte: Análise de Regressão com Dados Seccionais – Continuação**
 1. **Informação Qualitativa: Variáveis Explicativas Binárias (“Dummy”)**
 - 1.1 Descrição de informação qualitativa (W7.1)
 - 1.2 Uma única variável *dummy* (W7.2)
 - 1.3 Variáveis *dummy* para várias categorias (W7.3)
 - 1.4 Interações envolvendo variáveis *dummy* (W7.4)
 2. **Modelos para Variáveis Dependentes Binárias**
 - 2.1 O modelo linear de probabilidades (W7.5, W7.7 e W8.5)
 - 2.2 Os modelos logit e probit (W17.1)
- **2^a Parte: Análise de Regressão com Séries Temporais**
 3. **Análise de Regressão Básica**
 - 3.1 A natureza dos dados de séries temporais (W10.1)
 - 3.2 Exemplos de modelos de regressão de séries temporais (W10.2)
 - 3.3 Propriedades do OLS em pequenas amostras sob as hipóteses clássicas (W10.3)
 - 3.4 Forma funcional e variáveis *dummy* (W10.4)
 - 3.5 Tendências e sazonalidade (W10.5)
 4. **Tópicos Adicionais sobre a Utilização do OLS**
 - 4.1 Séries temporais estacionárias e fracamente dependentes (W11.1)
 - 4.2 Propriedades assintóticas do OLS (W11.2)
 - 4.3 Séries temporais altamente persistentes na análise de regressão (W11.3)
 - 4.4 Modelos dinamicamente completos e a ausência de autocorrelação (W11.4)

5. Autocorrelação e Heteroscedasticidade

- 5.1 Propriedades do OLS com erros autocorrelacionados (W12.1)
- 5.2 Testes de autocorrelação (W12.2)
- 5.3 Diferenciação e autocorrelação (W12.4)
- 5.4 Heteroscedasticidade em regressões de séries temporais (W12.6)

• 3ª Parte: Introdução aos Dados de Painel

6. Introdução aos Métodos para Dados de Painel

- 6.1 Agregação de dados seccionais de diferentes períodos de tempo (W13.1)
- 6.2 Análise de política com dados seccionais agregados (W13.2)
- 6.3 Análise de dados de painel de dois períodos de tempo (W13.3)
- 6.4 Análise de política com dados de painel de dois períodos de tempo (W13.4)

Bibliografia

• Básica

- Wooldridge, J. M. (2016) (W), *Introductory Econometrics: a Modern Approach*, 6th. ed., Cengage Learning.

• Complementar

- Stock, J. H. e Watson, M. W. (2015), *Introduction to Econometrics*, 3rd ed., Pearson.