



ISEG - INSTITUTO SUPERIOR DE ECONOMIA E GESTÃO
Universidade de Lisboa

Econometria
Licenciaturas em Economia e Finanças
2º Semestre - 2018/2019

PROGRAMA

1ª 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)

2ª 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: 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)
- 6.5 Diferenciação com mais do que dois períodos de tempo (W13.5)



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.

AVALIAÇÃO DE CONHECIMENTOS

O aluno pode optar por fazer avaliação ao longo do semestre (ALS) ou avaliação com base num exame final. No entanto, a equipa recomenda fortemente a opção da ALS por permitir uma maior possibilidade de sucesso escolar.

1. **Avaliação em EN:** requer a resolução de 2 provas individuais (PI1 e PI2), cada uma com ponderação de 50%.

Provas escritas individuais: serão realizadas em dois momentos, na semana de paragem das aulas e no final do semestre. Na primeira prova será avaliada a matéria respeitante às primeiras 7 semanas de aulas e terá a duração de 1h, enquanto na segunda prova, também com duração de 1 h, será avaliada a matéria respeitante às restantes aulas. Um aluno que obtenha uma nota inferior a 6 numa destas duas provas, será considerado reprovado. Note-se que este sistema requer obrigatoriamente a realização de ambas a PI1 e PI2.

2. **Avaliação em ER:** a classificação final será igual à obtida no exame de recurso.

Consulta - na realização das provas escritas referidas acima os estudantes poderão utilizar os seguintes elementos de consulta:

- um formulário
- as tabelas estatísticas

O formulário e as tabelas encontram-se publicados na página da disciplina e é da responsabilidade dos alunos trazê-los no dia da prova. Estes elementos não podem ter nenhuma anotação nem qualquer outro conteúdo que não seja feito pela equipa de docentes. O não cumprimento desta norma é considerado fraude decorrente de cópia sendo aplicado o Artigo 12º do RGAC das Licenciaturas.

Se nalguma das épocas especiais de exame o número de alunos inscritos for inferior ou igual a 10, a prova escrita poderá ser substituída por uma prova oral.

Responsável:

Esmeralda Arranhado Ramalho

Email: eramalho@iseg.ulisboa.pt