
Ano Letivo 2021-22

Unidade Curricular COMPLEMENTOS DE ESTATÍSTICA

Cursos MÉTODOS QUANTITATIVOS APLICADOS À ECONOMIA E À GESTÃO (3.º Ciclo) (*)
ECONOMETRIA
ECONOMIA MATEMÁTICA
ESTATÍSTICA
INVESTIGAÇÃO OPERACIONAL

(*) Curso onde a unidade curricular é opcional

Unidade Orgânica Faculdade de Economia

Código da Unidade Curricular 16741012

Área Científica MÉTODOS QUANTITATIVOS

Sigla

Código CNAEF (3 dígitos) 460

Contributo para os Objetivos de
Desenvolvimento Sustentável - 4;8
ODS (Indicar até 3 objetivos)

Línguas de Aprendizagem

Inglês

Modalidade de ensino

Presencial (e/ou à distância)

Docente Responsável

Efigénio da Luz Rebelo

DOCENTE	TIPO DE AULA	TURMAS	TOTAL HORAS DE CONTACTO (*)
Patrícia Susana Lopes Guerrilha dos Santos Pinto	OT	OT1	1OT
Efigénio da Luz Rebelo	OT	OT1	1OT
Jorge Miguel Lopo Gonçalves Andraz	OT	OT1	1OT
Guilherme José Fresca Mirador de Andrade Castela	OT	OT1	1OT
Eugénia Maria Dores Maia Ferreira	OT	OT1	1OT
Luís Miguel Soares Nobre de Noronha e Pereira	OT	OT1	1OT

* Para turmas lecionadas conjuntamente, apenas é contabilizada a carga horária de uma delas.

ANO	PERÍODO DE FUNCIONAMENTO*	HORAS DE CONTACTO	HORAS TOTAIS DE TRABALHO	ECTS
1º	Q2,Q1	30S; 12OT	560	20

* A-Anual;S-Semestral;Q-Quadrimestral;T-Trimestral

Precedências

Sem precedências

Conhecimentos Prévios recomendados

Inferência estatística

Objetivos de aprendizagem (conhecimentos, aptidões e competências)

Complementar o conhecimento de análise de regressão, de forma a selecionar e aplicar técnicas apropriadas para a análise de determinadas questões de investigação; reconhecer as limitações do Modelo Linear Probabilístico e as potencialidades da regressão logística; conduzir testes de hipóteses em modelos binomiais, multinomiais e de variável dependente limitada e interpretar os resultados; distinguir diferentes modelos de sucessões cronológicas de forma a selecionar e saber aplicar o modelo adequado; validar modelos de equações estruturais com variáveis latentes, especificados enquanto modelos de estrutura de covariância ou segundo a abordagem pls (partial least squares), utilizando um software adequado; compreender os conceitos e técnicas da análise categórica, e perceber o interesse da análise conjunta; dominar os conceitos dos métodos de três vias para a análise de dados e perceber os procedimentos STATIS e COSTATIS; saber validar uma solução na análise de clusters.

Conteúdos programáticos

Módulo I - Modelos com Variável Dependente Binária

1. Análise clássica de regressão
2. Modelo Linear Probabilístico
3. Modelos Logit e Probit

Módulo II - Modelos Multinomiais e Modelos de Variável Dependente Limitada

1. Modelos de resposta sem ordem
2. Modelos de resposta ordenada
3. Amostras truncadas
4. Dados censurados

Módulo III - Sucessões Cronológicas

1. Estacionaridade
2. Modelos de tipo ARMA
3. Modelos de tipo GARCH

Módulo IV - Modelos de Equações Estruturais com Variáveis Latentes

1. CB-SEM vs PLS-SEM
2. Modelos, variáveis, equações e parâmetros
3. Aplicação do método
4. Desenvolvimentos em SEM
5. SmartPLS e Amos

Módulo V - Análise Categórica e Procedimento STATIS

1. Estruturas de dados
2. Análise Categórica de Componentes Principais
3. Análise de co-inércia
4. STATIS
5. COSTATIS
6. Análise Conjunta

Módulo VI - Análise de Clusters

1. Medidas de semelhança
2. Algoritmos de formação de clusters
3. Número de clusters
4. Perfil e validação

Metodologias de ensino (avaliação incluída)

A componente letiva da unidade curricular estrutura-se em 6 módulos, a que correspondem um total de 36 horas teórico-práticas de ensino e 12 horas de orientação tutorial.

De avaliação obrigatória por trabalho individual, em pelo menos um dos módulos, nesse(s) módulo(s) o estudante terá o acompanhamento do(s) docente(s).

Bibliografia principal

Abdi, H., Williams, L. J., Valentin, D. e Bennani-Dosse, M. (2012), STATIS and DISTATIS: Optimum Multitable Principal Component Analysis and Three-way Metric Multidimensional Scaling. *Wiley Interdisciplinary Reviews: Computational Statistics* . 4 (2), 124-167.

Brooks, C. (2019), *Introductory Econometrics for Finance* , 4th Edition, Cambridge, UK.

Cameron, A. and Triverdi, P. (2005), *Microeconometrics: Methods and Applications* , Cambridge, UK.

Collier, J.E. (2020), *Applied Structural Equation Modeling Using Amos* . NY: Routledge.

Dray, S.; Chessel, D. e Thioulouse, J. (2003). Co-inertia Analysis and the Linking of Ecological Data Tables. *Ecology* , 84(11), 3078-3089.

Everitt, B.S., Landau, S., Leese, M., & Stahl, D. (2011). *Cluster Analysis* (5th Edition). Wiley, USA.

Gujarati, D.N. (2020), *Basic Econometrics* , McGrawHill

Hair J.F., Hult G.T., Ringle C. (2017), *A Primer on Partial Least Squares Structural Equation Modelling (PLS-SEM)* (2nd Edition), Los Angeles, CA: SAGE Publications.

Academic Year 2021-22

Course unit COMPLEMENTS OF STATISTICS

Courses QUANTITATIVE METHODS APPLIED TO ECONOMICS AND MANAGEMENT (*)
ECONOMETRICS
MATHEMATICAL ECONOMICS
STATISTICS
OPERATIONAL RESEARCH

(*) Optional course unit for this course

Faculty / School THE FACULTY OF ECONOMICS

Main Scientific Area

Acronym

CNAEF code (3 digits) 460

Contribution to Sustainable Development Goals - SGD 4;8
(Designate up to 3 objectives)

Language of instruction English

Teaching/Learning modality

Face-to-face (and/or by remote means)

Coordinating teacher

Efigénio da Luz Rebelo

Teaching staff	Type	Classes	Hours (*)
Patrícia Susana Lopes Guerrilha dos Santos Pinto	OT	OT1	10T
Efigénio da Luz Rebelo	OT	OT1	10T
Jorge Miguel Lopo Gonçalves Andraz	OT	OT1	10T
Guilherme José Fresca Mirador de Andrade Castela	OT	OT1	10T
Eugénia Maria Dores Maia Ferreira	OT	OT1	10T
Luís Miguel Soares Nobre de Noronha e Pereira	OT	OT1	10T

* For classes taught jointly, it is only accounted the workload of one.

Contact hours

T	TP	PL	TC	S	E	OT	O	Total
0	0	0	0	30	0	12	0	560

T - Theoretical; TP - Theoretical and practical ; PL - Practical and laboratorial; TC - Field Work; S - Seminar; E - Training; OT - Tutorial; O - Other

Pre-requisites

no pre-requisites

Prior knowledge and skills

Statistical inference

The students intended learning outcomes (knowledge, skills and competences)

Complement the knowledge on regression analysis, in order to select and apply the appropriate techniques to modelling and analyzing relevant research questions; recognize the limitations of the Linear Probability Model when compared to the Binary Logistic Regression; conduct hypothesis testing in the context of binomial, multinomial, and limited dependent variable models; distinguish between different types of time series models so that the appropriate model can be chosen and properly applied; estimate and validate structural equation models with latent variables, either specified as covariance structured models or as a result of a pls (partial least squares) approach, using an adequate software; understand the main concepts and techniques of categorical analysis and realize the interest on conjoint analysis; understand the main concepts of three-way methods to analyze data, and understand the STATIS and COSTATIS procedures; validate a particular solution using cluster analysis.

Syllabus

Module I - Binary Dependent Variable Models

1. Classical regression analysis
2. Linear Probability Model
3. Logit & Probit models

Module II - Multinomial Models & Limited Dependent Variable Models

1. Unordered response models
2. Ordered response models
3. Truncated samples
4. Censored data

Module III - Time Series

1. Stationarity
2. ARMA models
3. GARCH models

Module IV - Structural Equations Models with Latent Variables

1. CB-SEM vs PLS-SEM
2. Models, variables, equations and parameters
3. Steps to apply the method
4. Advances in SEM
5. SmartPLS and Amos

Module V - Categorical Analysis and STATIS Procedure

1. Data structures
2. Main Component Categorical Analysis
3. Co-inertia Analysis
4. STATIS
5. COSTATIS
6. Conjoint Analysis

Module VI - Cluster Analysis

1. Similarity measures
2. Clustering algorithms
3. Number of clusters
4. Profile and validation

Teaching methodologies (including evaluation)

The lecture component is structured in 6 modules, corresponding to a total of 36 hours of mixed lecture classes and 12 hours of tutorial orientation.

The students will submit, to be marked, an individual essay covering at least one of the modules' contents. To prepare the essay, the students will be assisted by the lecturer(s).

Main Bibliography

Abdi, H., Williams, L. J., Valentin, D. e Bennani-Dosse, M. (2012), STATIS and DISTATIS: Optimum Multitable Principal Component Analysis and Three-way Metric Multidimensional Scaling. *Wiley Interdisciplinary Reviews: Computational Statistics* . 4 (2), 124-167.

Brooks, C. (2019), *Introductory Econometrics for Finance* , 4th Edition, Cambridge, UK.

Cameron, A. and Triverdi, P. (2005), *Microeconometrics: Methods and Applications* , Cambridge, UK.

Collier, J.E. (2020), *Applied Structural Equation Modeling Using Amos* . NY: Routledge.

Dray, S.; Chessel, D. e Thioulouse, J. (2003). Co-inertia Analysis and the Linking of Ecological Data Tables. *Ecology* , 84(11), 3078-3089.

Everitt, B.S., Landau, S., Leese, M., & Stahl, D. (2011). *Cluster Analysis* (5th Edition). Wiley, USA.

Gujarati, D.N. (2020), *Basic Econometrics* , McGrawHill

Hair J.F., Hult G.T., Ringle C. (2017), *A Primer on Partial Least Squares Structural Equation Modelling (PLS-SEM)* (2nd Edition), Los Angeles, CA: SAGE Publications.