



CENTRO DE CIÊNCIAS JURÍDICAS E ECONÔMICAS
DEPARTAMENTO DE ECONOMIA

Plano de Ensino - 2019/1									
Universidade Federal do Espírito Santo						Campus:		Goiabeiras	
Curso:	Ciências Econômicas								
Departamento Responsável:			Economia						
Data de Aprovação (Art. nº 91):			04.12.2018						
Docente Responsável:			Edson Zambon Monte (edsonzambon@yahoo.com.br)						
Qualificação/link para o Currículo Lattes:					http://lattes.cnpq.br/5543595580825181				
Disciplina:		Econometria I				Código:		ECO-03719	
Pré-requisito:		STA-00000 e ECO-03715				Carga Horária Semestral:		60	
Créditos:		Distribuição da Carga Horária Semestral							
		04		Teoria		Exercício		Laboratório	
				60		---		---	
Ementa:		Modelos de regressão linear simples: estimação pelo Método de Mínimos Quadrados Ordinários; inferência. Modelos de regressão linear múltipla: estimação; inferência. Regressão múltipla com informação qualitativa: variáveis binárias. Problemas econométricos do modelo de regressão linear: heteroscedasticidade; autocorrelação; multicolinearidade; problemas de especificação e erro nas variáveis. Aplicação com o software econométrico/estatístico.							
Objetivos Específicos:		O objetivo da disciplina é fornecer uma base do instrumental padrão para a estimação de modelos econométricos, preparando o aluno para entender, analisar e elaborar trabalhos aplicados de econometria, que são centrais em grande parte das áreas de teoria econômica. Para esse fim, o curso será centrado no modelo clássico de regressão linear (simples e múltipla) e os problemas econométricos que podem comprometer as suposições estatísticas de tal modelo. A disciplina também objetiva capacitar os alunos na utilização da teoria econométrica, por meio de exercícios aplicados resolvidos manualmente ou em microcomputador. O curso compreende aulas teóricas e aplicações práticas.							
Conteúdo Programático:		1. Origem histórica 1.1. Introdução e interpretação moderna; 1.2. Estatística e dependência funcional; 1.3. Regressão x correlação, terminologia e notação. 2. Teoria econômica e empirismo 2.1. Modelo para estimação de variáveis econômicas e o conceito de regressão da população; 2.2. A natureza do termo estocástico e função de regressão amostral. 3. O problema da estimação 3.1. Regressão simples e o método dos mínimos quadrados ordinários; 3.2. Propriedades dos estimadores de mínimos quadrados;							

	3.3. O coeficiente de determinação e análise de correlação; 3.4. Funções que se tornam lineares por transformação. 4. Testes de hipóteses e predição 4.1. Estimação do intervalo de confiança para os parâmetros e testes de hipóteses; 4.2. Análise de variância para a regressão e o problema da predição. 5. Análise da regressão múltipla 5.1. Um modelo de três variáveis: notação, suposições, interpretação e equação de regressão; 5.2. O coeficiente de determinação e os coeficientes de regressão múltipla e parcial; 5.3. Análise de variância e testes de hipóteses. 6. O modelo de regressão linear geral 6.1. O modelo de regressão linear geral e notação matricial; 6.2. Estimação, coeficiente de determinação e a matriz de correlação. 7. Modelos de regressão com variáveis binárias (<i>dummies</i>) 7.1. A natureza das variáveis <i>dummies</i> e modelos com variáveis <i>dummies</i>; 7.2. Uso em análise sazonal. 8. Violações dos pressupostos básicos 8.1. Multicolinearidade: natureza, consequências, detecção, possível correção e predição; 8.2. Heteroscedasticidade: natureza, consequências, detecção e métodos de correção; 8.3. Autocorrelação: natureza, consequências, detecção e métodos de correção; 8.4. Problemas de especificação: natureza, consequências, detecção e métodos de correção.
Metodologia:	A metodologia da aula compreenderá de exposições dialogadas de conceitos (teóricos e matemáticos) e pontos relevantes, no que se refere à econometria. Nas aulas teóricas serão utilizados o quadro branco e pincel. As aulas práticas serão ministradas no laboratório de informática do CCJE, fazendo-se do uso dos <i>softwares</i>: <i>R project</i>, <i>R studio</i> e <i>Eviews</i>.
Critérios/Processo de Avaliação da Aprendizagem:	O aluno será avaliado por meio de três provas e de exercícios/tarefas a serem entregues ao longo do semestre. Cada prova possui peso 0,3 no cálculo da nota final, enquanto a média dos exercícios possui peso 0,1. Aqueles que obtiverem média semestral igual ou superior a 7,0 (sete) ficarão dispensados da prova final. Após a prova final: $((\text{Média Semestral} + \text{Prova final})/2)$ igual ou maior do que 5,0 = Aprovado. Não haverá prova substitutiva antes da prova final. Os alunos que perderem uma das provas semestrais poderão fazer a prova final como substitutiva. A frequência às aulas será observada rigorosamente. Será reprovado por falta o aluno que não obtiver no mínimo 75% (setenta e cinco por

	cento) de frequência, conforme Regimento Geral da UFES. O professor da disciplina não aceitará nenhum tipo de atestado para compensar ou justificar faltas. Caso seja necessário e naqueles casos previstos em lei, o aluno deverá procurar a Pró-Reitoria de Graduação para solicitar amparo legal às suas atividades discentes. 1ª prova: 04.09.2018 2ª prova: 04.10.2018 3ª prova: 20.11.2018 Prova final: 11.12.2018
Bibliografia Básica:	GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. Econometria básica. 5ª ed. Porto Alegre: McGrawHill/Bookman, 2011, 924p. HILL, C.; GRIFFITHS, W.; e JUDGE, G. Econometria. 2 ed. São Paulo, Editora Saraiva, 2008. 471p. WOOLDRIDGE, J. M. Introdução à econometria: uma abordagem moderna. 3 ed. São Paulo: Pioneira Thomson Learning, 2006. 684 p.
Bibliografia Complementar:	GREENE, W. H. Econometrics analysis. 5 ed. New Jersey: Prentice Hall, 2002. 802 p. GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. Basic econometrics. 5 ed. New York: McGraw-Hill/Irwin, 2008. 944 p. HOFFMANN, R. Estatística para Economistas. 4ª ed. São Paulo: Cengage Learning, 2006. 432p. KENNEDY, P. Manual de Econometria. 6ª ed. Rio de Janeiro: Elsevier, 2009. 597 p. MONTGOMERY, D. C.; PECK, E, A.; VINING, G. G. Introduction to linear regression analysis. 4 ed. New Jersey: Wiley Interscience, 2006, 612 p. PINDYCK, R. S.; RUBINFELD, D. L. Econometria: modelos e previsões. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004. 726 p. STOCK, J. H.; WATSON, M. Econometria. São Paulo: Addison Wesley, 2004. 485 p. VASCONCELOS, M. A.; ALVES, D. (Coord.). Manual de econometria: nível intermediário. São Paulo: Atlas, 2000. 308 p. WOOLDRIDGE, J. M. Econometric analysis of cross section and panel data. Cambridge, Mass: MIT Press, 2002.