CENTRO DE CIÊNCIAS JURÍDICAS E ECONÔMICAS
DEPARTAMENTO DE ECONOMIA

Plano de Ensino - 2020/1 (Earte)			
Universidade Federal do Espírito Santo		Campus:	**Goiabeiras**
Curso:	**Ciências Econômicas**		
Departamento Responsável:	**Economia**		
Data de Aprovação (Art. nº 91):			
Docente Responsável:	**Edson Zambon Monte (edsonzambon@yahoo.com.br ou edson.monte@ufes.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 econométrico, 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. Extensões do modelo de regressão linear. **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 (*dummies*)** 7.1. A natureza das variáveis *dummies* e modelos com variáveis *dummies*; 7.2. Uso em análise sazonal. **8. Violações às suposições básicas do MRLC** 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. As aulas e atividades serão realizadas por meio das ferramentas do G Suite, tais como: Google Meet, Google Classroom, Google Forms, entre outras. Comunicações serão feitas pelo portal do professor da UFES e ferramentas do Google. As aulas serão ministradas de formas síncronas e assíncronas. A previsão é de que cerca de 75% das aulas sejam síncronas, acontecendo nos horários previstos na oferta do componente curricular: terça-feira (9 as 11 horas) e quinta-feira (7 as 9 horas). O restante das aulas/atividades (25%) será realizado de forma assíncrona, incluindo: listas de exercícios não avaliativas, aulas gravadas, etc. Importante: 1) As atividades síncronas e assíncronas poderão ser gravadas para utilização restrita aos fins a que se destina esta disciplina, facultando-se ao aluno seu direito de não ser gravado ou filmado, mediante expressa manifestação; 2) Haverá durante a própria transmissão das atividades síncronas, o alerta escrito e verbal de que é proibida a utilização daquelas imagens sem expressa autorização (BORDAS, 2020).

Recursos Pedagógicos / Tecnológicos	Aulas ao vivo (síncronas) nos horários previstos na oferta do componente curricular: terça-feira (9 as 11 horas) e quinta-feira (7 as 9 horas). Aulas/atividades assíncronas, incluindo: listas de exercícios não avaliativas, aulas gravadas, entre outras. As aulas e atividades serão realizadas por meio das ferramentas do G Suite, tais como: Google Meet, Google Classroom, Google Forms, entre outras. Comunicações serão feitas pelo portal do professor da UFES e ferramentas do Google.
Critérios/Processo de Avaliação da Aprendizagem:	O aluno será avaliado por meio de duas provas a serem realizadas ao longo do semestre. Cada prova terá um peso no cálculo da nota parcial: 1ª Prova: 0,40; e, 2ª Prova: 0,60. Aqueles que obtiverem média semestral igual ou superior a 7,0 (sete) ficarão dispensados da prova final. Após a prova final: ((Média Semestral + Prova final)/2) igual ou maior do que 5,0 = Aprovado. Não haverá prova substitutiva antes da prova final, a não ser nos casos previstos em lei e/ou nas normas da UFES relativas ao Ensino-Aprendizagem Remoto Temporário e Emergencial (Earte). A frequência às aulas será observada de acordo com casos previstos em lei, e em conformidade com as normas da UFES relativas ao Earte. 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 fica no direito de alterar as datas das provas, com aviso prévio, em conformidade com as normas da UFES relativas ao Earte.
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. HEISS, F. **Using R for introductory econometrics**. Createspace Independent Publishing Platform, 2016. HOFFMANN, R. **Estatística para Economistas**. 4ª ed. São Paulo: Cengange Learning, 2006. 432p. HORTON, N. J.; KLEINMAN, K. **Using R for data management, statistical analysis, and graphics**. 2 ed. New York: Chapman and Hall/CRC, 2011. KENNEDY, P. **Manual de Econometria**. 6ª ed. Rio de Janeiro: Elsevier, 2009. 597 p. KLEIBER, C.; ZEILEIS, A. **Applied econometrics with R**. New York: Springer, 2008.

	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.