



Departamento de Economia
CENTRO DE CIÊNCIAS JURÍDICAS E ECONÔMICAS

PROGRAMA DA DISCIPLINA

CARACTERIZAÇÃO DA DISCIPLINA						
DISCIPLINA		CRÉDITO	CARGA HORÁRIA	PRÉ-REQUISITO	OBRIG./ OPT.	PERÍODO
CÓDIGO	NOME	4	60	-	OBRIG.	2015/2
ECO 03719	ECONOMETRIA I					
PROFESSOR: RENATA COUTO MOREIRA						

EMENTA
Números-índices. 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: heterocedasticidade; autocorrelação; multicolinearidade; problemas de especificação e erro nas variáveis.

OBJETIVOS DA DISCIPLINA
<ul style="list-style-type: none">• Oferecer conhecimentos básicos sobre a análise econométrica, o modelo de regressão linear clássico e o método de estimação por Mínimos Quadrados Ordinários (MQO).• Relacionar a análise dos modelos ajustados à sua adequação à teoria e à história econômica.• Introduzir ferramentas para avaliar estatisticamente as estimativas por Intervalos de Confiança e Testes de Hipóteses, o problema da estimação.• Capacitar o estudante para realizar análises de previsão a partir da aplicação dos métodos abordados.



CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

I – Números-índices

- a) Índice de Preço
- b) Índice de Quantidade
- c) Cálculo de Valores Reais

II – Modelos de regressão linear simples

- a) A natureza da análise de regressão
- b) Estimação pelo Método de Mínimos Quadrados Ordinários
- c) O modelo clássico de regressão linear
- d) Propriedades dos estimadores de MQO
- e) O coeficiente de determinação
- f) O modelo normal de regressão linear clássico
- g) Intervalos de confiança e Testes de hipótese
- h) Análise de regressão e análise de variância
- i) Avaliação dos resultados da análise de regressão

III – Modelos de regressão linear múltipla

- a) Estimação por MQO
- b) Variâncias e covariâncias
- c) Coeficiente de determinação e de correlação múltiplo
- d) Análise de variância da RLM
- e) Inferência e testes de hipóteses

IV – Regressão múltipla com informação qualitativa: variáveis binárias

- a) A Natureza das variáveis binárias
- b) Regressão sobre uma variável quantitativa e uma qualitativa
- c) Regressão sobre uma variável quantitativa e duas qualitativas
- d) Comparando duas regressões: abordagem da variável *dummy*
- e) Aspectos técnicos do modelo de variáveis binárias

V - Problemas econométricos do modelo de regressão linear

- a) Multicolinearidade
- b) Heterocedasticidade
- c) Autocorrelação
- d) Problemas de especificação e erro nas variáveis

BIBLIOGRAFIA

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

GUJARATI, Damodar. Econometria básica. Rio de Janeiro: Elsevier: Campus, 2006. xxiv, 812 p.

SARTORIS, Alexandre. Estatística e Introdução à Econometria. 1ª Ed. São Paulo: Saraiva, 2006, 426p.

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. Introdução à econometria: uma abordagem moderna. São Paulo: Thomson, 2006. 684 p.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

HOFFMANN, Rodolfo; VIEIRA, Sônia. Análise de regressão: uma introdução a econometria. 2. ed. - São

Paulo: Hucitec, 1983. viii, 379p. (Economia & planejamento. Obras didáticas)

JOHNSTON, John. Métodos econométricos. São Paulo: Atlas, 1974. 318p.

KMENTA, Jan. Elementos de econometria. 2ª ed. - São Paulo: Atlas, 1988.

PINDYCK, Robert S.; RUBINFELD, Daniel L. Econometria: modelos & previsões. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004. xxviii, 726 p.



Departamento de Economia
CENTRO DE CIÊNCIAS JURÍDICAS E ECONÔMICAS

CRITÉRIOS DE AVALIAÇÃO DA APRENDIZAGEM

As avaliações serão realizadas segundo as normas da UFES e constarão de duas provas e um trabalho a serem elaborados durante o semestre. Para cada avaliação será atribuída nota de zero a dez. Cada prova terá peso de 30%. O trabalho terá peso de 30%. A participação em aula e realização dos exercícios solicitados terá peso de 10%. O estudante que perder a prova poderá fazer uma prova de reposição no final do semestre. O estudante que tirar menos que 70% terá direito a fazer a prova final.