



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.	2016/1
ECO 03719	ECONOMETRIA I					
PROFESSOR: RENATA COUTO MOREIRA						

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: 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 ferramental 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
<p>I – Modelos de regressão linear simples</p> <ul style="list-style-type: none">a) A natureza da análise de regressãob) Estimação pelo Método de Mínimos Quadrados Ordináriosc) O modelo clássico de regressão lineard) Propriedades dos estimadores de MQOe) O coeficiente de determinaçãof) O modelo normal de regressão linear clássicog) Intervalos de confiança e Testes de hipóteseh) Análise de regressão e análise de variânciai) Avaliação dos resultados da análise de regressão <p>II – Modelos de regressão linear múltipla</p> <ul style="list-style-type: none">a) Estimação por MQOb) Variâncias e covariânciasc) Coeficiente de determinação e de correlação múltiplod) Análise de variância da RLMe) Inferência e testes de hipóteses <p>III – Regressão múltipla com informação qualitativa: variáveis binárias</p> <ul style="list-style-type: none">a) A Natureza das variáveis bináriasb) Regressão sobre uma variável quantitativa e uma qualitativac) Regressão sobre uma variável quantitativa e duas qualitativasd) Comparando duas regressões: abordagem da variável <i>dummy</i>e) Aspectos técnicos do modelo de variáveis binárias



IV - 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.

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 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.