

## PROGRAMA DA DISCIPLINA

CARACTERIZAÇÃO DA DISCIPLINA						
DISCIPLINA		CRÉDITO	CARGA HORÁRIA	PRÉ-REQUISITO	OBRIG./OPT.	PERÍODO
CÓDIGO	NOME	4	60	STA-02114 e ECO-03715	OBRIG.	2017/1
ECO-03719	ECONOMETRIA I					
PROFESSOR: EDSON ZAMBON MONTE						

EMENTA
Números-Índices. Modelos de Regressão Linear Simples: Estimação – 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.

OBJETIVOS DA DISCIPLINA
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
<p><b>1. Números índices</b></p> <p>1.1. Índice de Preço;</p> <p>1.2. Cálculo de Valores Reais.</p> <p><b>2) Modelos de regressão linear simples</b></p> <p>2.1. A natureza da análise de regressão;</p> <p>2.2. Modelos de regressão simples: o problema da estimação;</p> <p>2.3. Modelo clássico de regressão linear normal (MCRLN);</p> <p>2.4. Modelos de regressão simples: estimação de intervalo e testes de hipóteses;</p> <p>2.5. Extensões do modelo de regressão linear;</p> <p>2.6. Aplicação <i>software</i> estatístico/econométrico.</p> <p><b>3) Modelos de regressão linear múltipla</b></p> <p>3.1. Modelos de regressão múltipla: o problema da estimação;</p> <p>3.2. Modelos de regressão múltipla: o problema da inferência;</p> <p>3.3. A abordagem matricial para o modelo de regressão linear;</p> <p>3.4. Aplicação <i>software</i> estatístico/econométrico.</p> <p><b>4) Modelos de regressão com variáveis binárias (<i>dummies</i>)</b></p> <p>4.1. A natureza das variáveis <i>dummies</i>;</p> <p>4.2. Modelos com variáveis <i>dummies</i>;</p> <p>4.3. Aplicação <i>software</i> estatístico/econométrico.</p> <p><b>5) Problemas Econométricos do Modelo de Regressão Linear</b></p> <p>5.1. Multicolinearidade;</p> <p>5.2. Heteroscedasticidade;</p> <p>5.3. Autocorrelação;</p> <p>5.4. Problemas de Especificação;</p> <p>5.5. Aplicação <i>software</i> estatístico/econométrico.</p>

BIBLIOGRAFIA
BIBLIOGRAFIA BÁSICA
GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. <b>Econometria básica</b> . 5ª ed. Porto Alegre: McGrawHill/Bookman, 2011, 924p.

HILL, C.; GRIFFITHS, W.; e JUDGE, G. **Econometria**. 2 ed. São Paulo, Editora Saraiva, 2008. 471p.

HOFFMANN, R. **Estatística para Economistas**. 4ª ed. São Paulo: Cengage Learning, 2006. 432p.

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.

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.

WOOLDRIDGE, J. M. **Econometric analysis of cross section and panel data**. Cambridge, Mass: MIT Press, 2002.

#### CRITÉRIOS 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. 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. O professor da disciplina não aceitará nenhum tipo de atestado para compensar ou justificar faltas.