



CENTRO DE CIÊNCIAS JURÍDICAS E ECONÔMICAS
DEPARTAMENTO DE ECONOMIA

Plano de Ensino (2018/2)				
Universidade Federal do Espírito Santo		Campus:	Goiabeiras	
Curso:	Ciências Econômicas			
Departamento Responsável:	Economia			
Data de Aprovação (Art. nº 91):	05/07/2018			
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 estimativa 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 comprehende 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 estimativa 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 estimativa 3.1. Regressão simples e o método dos mínimos quadrados ordinários; 3.2. Propriedades dos estimadores de mínimos quadrados;			

	<p>3.3. O coeficiente de determinação e análise de correlação;</p> <p>3.4. Funções que se tornam lineares por transformação.</p> <p>4. Testes de hipóteses e predição</p> <p>4.1. Estimação do intervalo de confiança para os parâmetros e testes de hipóteses;</p> <p>4.2. Análise de variância para a regressão e o problema da predição.</p> <p>5. Análise da regressão múltipla</p> <p>5.1. Um modelo de três variáveis: notação, suposições, interpretação e equação de regressão;</p> <p>5.2. O coeficiente de determinação e os coeficientes de regressão múltipla e parcial;</p> <p>5.3. Análise de variância e testes de hipóteses.</p> <p>6. O modelo de regressão linear geral</p> <p>6.1. O modelo de regressão linear geral e notação matricial;</p> <p>6.2. Estimação, coeficiente de determinação e a matriz de correlação.</p> <p>7. Modelos de regressão com variáveis binárias (<i>dummies</i>)</p> <p>7.1. A natureza das variáveis <i>dummies</i> e modelos com variáveis <i>dummies</i>;</p> <p>7.2. Uso em análise sazonal.</p> <p>8. Violações dos pressupostos básicos</p> <p>8.1. Multicolinearidade: natureza, consequências, detecção, possível correção e predição;</p> <p>8.2. Heteroscedasticidade: natureza, consequências, detecção e métodos de correção;</p> <p>8.3. Autocorrelação: natureza, consequências, detecção e métodos de correção;</p> <p>8.4. Problemas de especificação: natureza, consequências, detecção e métodos de correção.</p>
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 softwares: <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: ((Média Semestral + 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.
Bibliografia Básica:	<p>GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. Econometria básica. 5ª ed. Porto Alegre: McGrawHill/Bookman, 2011, 924p.</p> <p>HILL, C.; GRIFFITHS, W.; e JUDGE, G. Econometria. 2 ed. São Paulo, Editora Saraiva, 2008. 471p.</p> <p>WOOLDRIDGE, J. M. Introdução à econometria: uma abordagem moderna. 3 ed. São Paulo: Pioneira Thomson Learning, 2006. 684 p.</p>
Bibliografia Complementar:	<p>GREENE, W. H. Econometrics analysis. 5 ed. New Jersey: Prentice Hall, 2002. 802 p.</p> <p>GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. Basic econometrics. 5 ed. New York: McGraw-Hill/Irwin, 2008. 944 p.</p> <p>HOFFMANN, R. Estatística para Economistas. 4ª ed. São Paulo: Cengage Learning, 2006. 432p.</p> <p>KENNEDY, P. Manual de Econometria. 6ª ed. Rio de Janeiro: Elsevier, 2009. 597 p.</p> <p>MONTGOMERY, D. C.; PECK, E. A.; VINING, G. G. Introduction to linear regression analysis. 4 ed. New Jersey: Wiley Interscience, 2006, 612 p.</p> <p>PINDYCK, R. S.; RUBINFELD, D. L. Econometria: modelos e previsões. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004. 726 p.</p> <p>STOCK, J. H.; WATSON, M. Econometria. São Paulo: Addison Wesley, 2004. 485 p.</p> <p>VASCONCELOS, M. A.; ALVES, D. (Coord.). Manual de econometria: nível intermediário. São Paulo: Atlas, 2000. 308 p.</p> <p>WOOLDRIDGE, J. M. Econometric analysis of cross section and panel data. Cambridge, Mass: MIT Press, 2002.</p>