

CURSO: CIÊNCIAS ECONÔMICAS	PLANO DE ENSINO
-----------------------------------	------------------------

DISCIPLINA: ECONOMETRIA I	CÓDIGO: ECO31077	CARGA HORÁRIA: 80 HORAS	CRÉDITOS: 04
-------------------------------------	----------------------------	-----------------------------------	------------------------

ANO LETIVO: 2020	SEMESTRE: 2	PERÍODO: 4º	TURMA: 4º PERÍODO
-------------------------	--------------------	--------------------	--------------------------

PROFESSOR (A): Walberti Saith

OBJETIVO DO CURSO:

Oferecer formação de nível superior em Ciências Econômicas a egressos do ensino médio, pautada, sobretudo, na ampliação dos horizontes intelectuais (constituindo uma base cultural ampla, que possibilite o entendimento de questões econômicas no seu contexto histórico-cultural) de modo a propiciar as competências e habilidades da profissão, respeitado o perfil profissional que preside o projeto pedagógico do curso. Além disso, o curso busca promover o ensino, a pesquisa e a extensão.

OBJETIVO DO DISCIPLINA:

Iniciar o estudante no estudo da Econometria, capacitando-o a entender e a utilizar ferramentas metodológicas associadas a essa área do conhecimento para estudar fenômenos econômicos. Dessa forma, a disciplina permite que o estudante seja apto a compreender quais são os métodos econométricos mais usuais na literatura para a formulação, estimação e testes de modelos econômicos, possibilitando que o aluno analise as relações econômicas e as implicações dela decorrentes sobre a sociedade como um todo.

AULAS POR UNIDADE:

Unidade I – 40 aulas
Unidade II – 40 aulas

EMENTA:

Conceitos básicos de análise de regressão. Modelo clássico de regressão linear. Mínimos quadrados ordinários – MQO. Precisão da estimação. Intervalo de confiança. Análise de variância ANOVA. Extensões do modelo de regressão. Regressão que passa pela origem. Variáveis padronizadas. Modelos logarítmicos. Modelos recíprocos. Variáveis instrumentais e especificação de modelo. Regressão múltipla. Estimação dos coeficientes. Máxima verossimilhança. Variáveis binárias. Previsões com modelos econométricos.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO:

Unidade I – Modelos de Regressão Linear

1.1 Introdução

- 1.1.1 Definição e Objetivos da Econometria
- 1.1.2 O Método Econométrico
- 1.1.3 Tipos e Características dos Dados Econômicos
- 1.2 A Natureza da Análise de Regressão
- 1.3 Análise de Regressão com Duas Variáveis: Algumas Ideias Básicas
- 1.4 Modelo de Regressão de Duas Variáveis: O Problema da Estimação
 - 1.4.1 Método dos Mínimos Quadrados Ordinários (MQO)
 - 1.4.2 Premissas do Modelo de Regressão Linear Clássico
 - 1.4.3 Erros-Padrão das Estimativas de Mínimos Quadrados
 - 1.4.4 O Teorema de Gauss-Markov
 - 1.4.5 O Coeficiente de Determinação (R^2)
- 1.5 Modelo Normal de Regressão Linear Clássico (MNRLC)
 - 1.5.1 A Distribuição de Probabilidade dos Termos de Erro u_i
 - 1.5.2 A Premissa de Normalidade de u_i
 - 1.5.3 Propriedades dos Estimadores de MQO Sob a Premissa de Normalidade
 - 1.5.4 O Método de Máxima Verossimilhança
- 1.6 A Regressão de Duas Variáveis: Estimação de Intervalo e Teste de Hipóteses
 - 1.6.1 Intervalos de Confiança para os Coeficientes de Regressão
 - 1.6.2 Intervalos de Confiança para a Variância
 - 1.6.3 Teste de Hipóteses

Unidade II – Extensões do Modelos de Regressão Linear

- 2.1 A Regressão que Passa pela Origem
- 2.2 Escalas e Unidades de Medidas
- 2.3 Regressão com Variáveis Padronizadas
- 2.4 Formas Funcionais dos Modelos de Regressão
- 2.5 O Modelo Log-Linear
- 2.6 Modelos Semilogarítmicos: Log-Lin e Lin-Log
- 2.7 Modelos Recíprocos
- 2.8 A Escolha da Forma Funcional
- 2.9 Análise de Regressão Múltipla: O Problema da Estimação
 - 2.9.1 Interpretação da Equação de Regressão Múltipla
 - 2.9.2 O Significado dos Coeficientes de Regressão Parciais
 - 2.9.3 Estimação dos Coeficientes Parciais de Regressão por meio dos Métodos de MQO e da Máxima Verossimilhança
 - 2.9.4 R^2 e R^2 ajustado
- 2.10 Análise de Regressão Múltipla: O Problema da Inferência
 - 2.10.1 Teste de Hipóteses na Regressão Múltipla
 - 2.10.2 Teste de Hipóteses Realativo aos Coeficientes de Regressão Individuais
 - 2.10.3 Teste da Significância Geral da Regressão Amostral
- 2.11 Modelos de Regressão com Variáveis Binárias
 - 2.11.1 A Natureza das Variáveis Binárias
 - 2.11.2 Modelos ANOVA
 - 2.11.3 Modelos ANOVA com Duas Variáveis Qualitativas
 - 2.11.4 Os Modelos ANCOVA
 - 2.11.5 Efeitos de Interação com o Uso de Variáveis Binárias
 - 2.11.6 O Emprego de Variáveis Binárias em Análises Sazonais

METODOLOGIA

- ◆ Elaboração de material de trabalho aplicado em sala de aula;

- ◆ Execução de aulas práticas no laboratório de informática.

AVALIAÇÃO:

- ◆ Prova 1 – 30%;
- ◆ Prova 2 – 30%;
- ◆ Artigo Final – 40%.

BIBLIOGRAFIA:

Básica:

GUJARATI, D. N. **Econometria básica**. 5. ed. - São Paulo: Pearson Makron Books, 2011.

HOFFMANN, R. **Estatística para economistas**. São Paulo: Pioneira, 2002.

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. **Introdução à econometria** - uma abordagem moderna. 4. ed. – São Paulo: Cengage Learning, 2010.

COMPLEMENTAR:

HOFFMANN, R.; VIEIRA, S. **Análise de regressão**. uma introdução à econometria. 3 ed. – São Paulo: Hucitec, 1998.

MORETTIN, Pedro A. **Econometria financeira** – um curso em séries temporais financeiras. 2. ed. - São Paulo: Edgard Blucher, 2011.

PINDYCK, R.; RUBINFELD, D. **Econometria** – modelos e previsões. Rio de Janeiro:Campus, 2004.