

Programa Analítico de Disciplina

ECO 450 - Econometria I

Departamento de Economia - Centro de Ciências Humanas, Letras e Artes

Catálogo: 2019

Número de créditos: 4

Carga horária semestral: 60h

Carga horária semanal teórica: 3h

Carga horária semanal prática: 1h

Semestres: II

Objetivos

O objetivo da disciplina ECO 450 – Econometria I é apresentar o modelo econométrico básico e seus pressupostos, estudar os problemas que podem surgir na estimação desse modelo, decorrentes da não-validade de alguns de seus pressupostos, além de algumas extensões. Pretende-se, ainda, orientar o aluno no uso de softwares econométricos e aplicação dos métodos estudados.

Ementa

Análise de Regressão Simples. Análise de Regressão Múltipla. Violação dos pressupostos do Modelo Clássico de Regressão Linear. Regressão sobre variáveis qualitativas. Modelos de Equações Simultâneas. Aulas de Laboratório: Estimação da relação das variáveis econômicas. Aplicação de modelos vistos ao longo do curso. Aulas de Laboratório: Interpretação estatística e econômica dos resultados estimados. Aulas de Laboratório: correção prática de violações estatísticas dos modelos propostos.

Pré e co-requisitos

EST 105 ou EST 106

Oferecimentos obrigatórios

Curso	Período
Ciências Econômicas	6

Oferecimentos optativos

Não definidos

ECO 450 - Econometria I

Conteúdo					
Unidade	T	P	ED	Pj	To
1. Análise de Regressão Simples 1. Conceitos básicos 2. O Problema da estimativa: Método de Mínimos Quadrados Ordinários (MQO) 3. Modelo Clássico de Regressão Linear 4. Propriedades dos estimadores de MQO 5. Hipótese de Normalidade 6. Formas Funcionais 7. Intervalo de confiança e Testes de hipóteses 8. Aplicação de Regressão Linear Simples a problemas do cotidiano e econômicos	14h	4h	0h	0h	18h
2. Análise de Regressão Múltipla 1. Abordagem matricial 2. Estimativa de MQO 3. Pressupostos do modelo clássico 4. Testes de Hipóteses 5. Aplicação de Regressão Linear Múltipla a problemas do cotidiano e econômicos	11h	3h	0h	0h	14h
3. Violação dos pressupostos do Modelo Clássico de Regressão Linear 1. Multicolinearidade 2. Heterocedasticidade 3. Autocorrelação 4. Erros de especificação 5. Práticas de diagnósticos e o processo de correção de violações de pressupostos	10h	3h	0h	0h	13h
4. Regressão sobre variáveis qualitativas 1. Natureza de variáveis dummies 2. Utilização e interpretação de variáveis dummies 3. Aplicação de variáveis qualitativas em problemas do cotidiano e econômicos	4h	2h	0h	0h	6h
5. Modelos de Equações Simultâneas 1. A natureza de Equações Simultâneas 2. Viés de simultaneidade 3. Problema de identificação em equações simultâneas 4. Identificação e escolhas de instrumentos e sua relação com o viés de simultaneidade 5. Estimadores que utilizam variáveis instrumentais (MQVI, MQ2E) 6. Aplicação em modelos econômicos	6h	3h	0h	0h	9h
Total	45h	15h	0h	0h	60h

(T)Teórica; (P)Prática; (ED)Estudo Dirigido; (Pj)Projeto; Total(To)

Planejamento pedagógico

A autenticidade deste documento pode ser conferida no site <https://siadoc.ufv.br/validar-documento> com o código: 68GH.12HR.ZVUK

Carga horária	Itens
Teórica	Apresentação de conteúdo oral e escrito com o apoio de equipamento (projektor, quadro-digital, TV, outros); e Apresentação de conteúdo oral e escrito em quadro convencional
Prática	Prática demonstrativa realizada pelo professor ou monitor, Prática executada por todos os estudantes e Resolução de problemas
Estudo Dirigido	<i>Não definidos</i>
Projeto	<i>Não definidos</i>
Recursos auxiliares	<i>Não definidos</i>

ECO 450 - Econometria I

Bibliografias básicas

Descrição	Exemplares
PINDYCK, R.S. RUBINFELD, D.L. Econometria: modelos e previsões. Tradução da quarta edição. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004.	13
GUJARATI, D. N. Econometria básica. 4. ed. São Paulo: Editora Campus, 2006. 846p.	21

Bibliografias complementares

Descrição	Exemplares
SARTORIS, A. Estatística e introdução à econometria. São Paulo: Saraiva, 2003.	2
STOCK, J.H.; WATSON, M.W. Econometria. São Paulo: Pearson Education. 2004.	1
VASCONCELLOS, M.A.S.; ALVES, D. (editores). Manual de econometria. São Paulo: Atlas, 2000.	1