

PROGRAMA DE ENSINO – (*à partir do sem. 2005.2*)

EMENTA: Modelo de Regressão Linear Simples e Múltipla. Identificação e correção de problemas relacionados com multicolinearidade, autocorrelação e heterocedasticidade. Séries Temporais.

1. IDENTIFICAÇÃO DA DISCIPLINA

- 1.1. Código: CNM 5241
- 1.2. Nome: Econometria
- 1.3. No. Horas/Aula : 04 semanais
- 1.4. Carga Horária : 60 horas

2. PRÉ-REQUISITO(S)

- 2.1. CNM 5331 – Estatística Econômica e Introdução à Econometria

3. IDENTIFICAÇÃO DA OFERTA: Curso de Graduação em Ciências Econômicas

4. OBJETIVOS DA DISCIPLINA

Oferecer aos alunos um conjunto de técnicas estatísticas e de modelagem que sirva para instrumentalizá-los à análise e ao tratamento de dados econômicos.

5. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

5.1. Regressão Simples.

- 5.1.1 Análise de regressão simples: interpretação dos coeficientes e utilidade. A estimação da equação pelo método de mínimos quadrados.
- 5.1.2. As hipóteses do modelo econométrico.
- 5.1.3. A inferência na regressão simples: teste de hipóteses e intervalos de confiança para β e α .
- 5.1.4. O ajustamento da regressão: o coeficiente de determinação (R^2)
- 5.1.5. Extensões do modelo linear: log-log (coeficiente de elasticidade) e log-lin (taxa de crescimento).

5.2. Regressão múltipla

- 5.2.1. Interpretação e significado dos coeficientes de regressão parcial.
- 5.2.1. O coeficiente de R^2 ajustado
- 5.2.3. Teste de hipóteses sobre coeficientes individuais, de significância global e de igualdade entre dois coeficientes, teste de estabilidade estrutural de modelos.
- 5.2.4. Noções sobre os testes de razão de verossimilhança, Wald e multiplicador de Lagrange.
- 5.2.5. Regressão sobre variáveis dummies.
- 5.2.6. Causalidade de Granger.

5.3. Problemas com a violação das hipóteses básicas.

- 5.3.1. Multicolinearidade: natureza do problema e conseqüências; detecção, medidas corretivas.
- 5.3.2. Heterocedasticidade: natureza do problema e conseqüências; detecção, medidas corretivas.
- 5.3.3. Autocorrelação: natureza do problema e conseqüências; detecção, medidas corretivas.
- 5.3.4. Erro de especificação: natureza do problema e conseqüências; detecção, medidas corretivas.

5.4. Séries temporais

- 5.4.1 Caracterização do processo estocástico estacionário.
- 5.4.2 Teste de raízes unitárias.
- 5.4.3. Regressão espúria e teste de co-integração.
- 5.4.4. Mecanismo de correção de erro.
- 5.4.5. Modelagem AR, MA e ARIMA.
- 5.4.6. A metodologia de Box-Jenkins.
- 5.4.6. Auto regressão vetorial (VAR)

6. BIBLIOGRAFIA

6.1. Bibliografia básica

GUJARATI, Damodar N. *Econometria Básica*. São Paulo: Makron Books Ltda.

6.2. Bibliografia Complementar

HILL, R. C.; GRIFFITHS, W.E & JUDGE, G.G. *Econometria*. São Paulo: Saraiva. 2003.

MADDALA, G.S. *Introdução à Econometria*. Rio de Janeiro: LTC, 2003.

MANUAL de ECONOMETRIA. Marcos A. S. Vasconcellos e Denisard Alves (coord). São Paulo: Atlas, 2000.

SARTORIS, Alexandre. *Estatística e Introdução à Econometria*. São Paulo: Saraiva, 2003.

SOARES, Ilton G.; CASTELAR, Ivan. *Econometria Aplicada com o Uso do Eviews*. Fortaleza: Edições Livro Técnico, 2003.