

MINISTÉRIO DA EDUCAÇÃO
UNIVERSIDADE FEDERAL DE SANTA CATARINA
CENTRO SÓCIO-ECONÔMICO
DEPARTAMENTO DE CIÊNCIAS ECONÔMICAS

PROGRAMA DE ENSINO

EMENTA: Regressão simples. Regressão múltipla. Problemas com a violação das hipóteses básicas. Modelos de equações simultâneas e equações em diferenças estocásticas.

1. Identificação da disciplina

Código : CNM 7241
Nome : Econometria
Nº de Horas/Aula : 04 semanais
Carga Horária : 72 horas/aula

2. Pré-requisito: CNM 7331 ou CNM 5331

3. Identificação da Oferta: *Curso de Graduação em Ciências Econômicas*

4. Objetivos da disciplina

4.1. Objetivo Geral

Oferecer um conjunto de conceitos que *capacitem os alunos ao tratamento estatístico dos dados*, visando através de técnicas estatísticas específicas obterem resultados quantitativos, *para maior compreensão do comportamento de variáveis e da relação entre as mesmas no ambiente econômico.*

4.2. Objetivo Específico

Estabelecer aos alunos capacidade no uso de software aplicado aos tratamentos estatísticos de dados econômicos e, fundamentalmente, aprender analisar e interpretar os resultados obtidos. Isto é, dar ao aluno capacidade para saber fazer, utilizando os conhecimentos estatísticos aprendidos no curso.

5. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

5.1. Regressão Simples.

- 5.1.1 Análise de regressão simples: interpretação dos coeficientes e utilidade e 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 e para a variável dependente e sua média;
- 5.1.4. O ajustamento da regressão: o coeficiente de determinação (R^2)
- 5.1.5. Extensões do modelo linear: modelos sem interceptos, log-log, log-lin, lin-log e recíprocos

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. Heterocedastidade: 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.

6. BIBLIOGRAFIA

GUJARATI¹, Damodar N., 2006, *Econometria Básica*. Elsevier - Editora Campus.
ENDERS², W. E., Applied Econometric Time Series, 2th edition Wiley ,2004;
PINDYCK, R.S. e RUBINFELD, D.L. Econometric Models and Economic Forecasts, 4th edition. McGraw-Hill, 1997.
HILL, R. C.; GRIFFITHS, W.E & JUDGE, G.G. *Econometria*. São Paulo: Saraiva. 2003.
Stock, James H. e Mark W. Watson. *Econometria*. São Paulo: Pearson - Addison-Wesley, 2005.
Wooldridge, Jeffrey M. *Introdução à Econometria: Uma Abordagem Moderna*. São Paulo: Thomson Learning, 2006.

¹ Livro texto principal.

² Livro texto principal.