

PLANO DE ENSINO

I. IDENTIFICAÇÃO

Curso: Ciências Econômicas		
Departamento: Ciências Econômicas		
Disciplina: Econometria I		Código: 43ECON1
Carga horária: 72 horas	Período letivo: 2023.1	Termo: 4º
Professor: Ana Paula Menezes Pereira		
Contato: ana.menezes@udesc.br		

II. EMENTA

Modelo de regressão simples. Modelo de regressão múltipla. Método dos mínimos quadrados ordinários. Inferência. Multicolinearidade. Heteroscedasticidade. Autocorrelação. Especificação do modelo. Variáveis explicativas qualitativas.

III. OBJETIVOS

Conhecer os conceitos básicos de econometria, através do ajuste e interpretação da regressão simples e múltipla de modelos lineares, a fim de compreender a aplicação de modelos econométricos na análise de hipóteses e pressupostos teóricos, respeitando os pressupostos básicos do modelo linear de regressão.

IV. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

Parte I – Introdução: Metodologia Científica. O método Econométrico, Tipos de dados, Regressão versus correlação, Terminologia e Notação. Operadores de Somatório e de Produto. Valores esperados, Operadores de Variância e Covariância.

Parte II - Regressão Linear Simples: FRP e FRA; Método dos Mínimos Quadrados Ordinários; Propriedades dos Estimadores de MQO; Coeficiente de determinação; Modelo Normal de Regressão Linear Clássico (MNRLC); Intervalos de confiança; Testes de Hipóteses.

Parte III - Modelo de Regressão Múltipla: Interpretação da equação de regressão linear múltipla; Formas funcionais; Coeficientes de regressão parciais; Coeficiente de determinação múltiplo e ajustado; Inferência estatística.

Parte IV: Multicolinearidade; Heteroscedasticidade; autocorrelação; especificação do modelo.

Parte V: Variáveis explicativas qualitativas.

V. METODOLOGIA DE ENSINO

Aula expositiva/dialogada com elaboração de exercícios de forma individual ou em grupo e utilização de outros instrumentos didático-pedagógicos que auxiliem na compreensão do conteúdo. Os exercícios práticos, quando indicado pelo professor, poderão ser desenvolvidos com o auxílio de programas econométricos.

VI. SISTEMA DE AVALIAÇÃO

Os alunos serão avaliados por meio de três provas presenciais, individuais e sem consulta e por um trabalho de aplicação. Quando indicado pela professora, a resolução de exercícios, resolvidos de forma individual ou em grupo, poderá somar bônus extras nas notas das provas. O peso na média final de cada prova é de 30% e do trabalho final é de 10%.

As segundas chamadas serão realizadas de acordo com o normatizado na UDESC pela RESOLUÇÃO Nº 039/2015 – CONSEPE.

Havendo alteração nas normativas da UDESC, diferentes formas de avaliações poderão ser feitas, sempre de acordo com os calendários e as normas vigentes, bem como as condições da Universidade.

VII. BIBLIOGRAFIA

Básica

GUJARATI, Damodar N. **Econometria Básica**. Rio de Janeiro: Campus, 2011.

HOFFMANN, Rodolfo. **Análise de Regressão: Uma Introdução à Econometria**. São Paulo: Hucitec, 2006.

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. **Introdução à Econometria: Uma Abordagem Moderna**. São Paulo: Thomson, 2006.

Complementar

PINDYCK, Robert S, RUBINFELD, Daniel L. **Econometria: modelos e previsões**. Rio de Janeiro: Campus, 2004.

HILL, R. Carter, GRIFFITHS, William E, JUDGE, George G. **Econometria**. São Paulo: Saraiva, 2003. 2.ed.

MATOS, O.C. de. **Econometria Básica**: teoria e aplicações. São Paulo: Atlas, 2000.

*Bibliografias auxiliares poderão ser indicadas durante o semestre.