

1. Identificação

Cód. Disciplina	Período	Créditos	Carga Horária	
020017	4 ^a	04	Semanal	Mensal
			04	60

Nome da Disciplina

ECONOMETRIA

Curso

CIÊNCIAS ECONÔMICAS

2. Pré-Requisito

Introdução à Estatística
Estatística Econômica e Introdução à Econometria

3. Ementa

Modelos econômicos lineares multivariados. Teoria da identificação. Métodos de estimação. Mínimos quadrados em dois e três estágios. Testes de restrições de identificação. Simulação com modelos econométricos usados no mundo. Utilização de pacotes econométricos.

4. Objetivos

4.1. Objetivo Geral:

Possibilitar a formação das competências básicas para assimilar o conhecimento de instrumentos analíticos, necessário para estimação empírica de relações econômicas. Introduzindo os métodos econométricos mais comumente usados na formação, estimação e teses de modelos econômicos, bem como os principais problemas surgidos na análise econométrica.

4. Objetivos

Objetivos Específicos:

- Desenvolver a teoria econométrica elementar de forma a possibilitar ao estudante melhor entendimento dos métodos empregados;
- Examinar as técnicas econométricas mais importantes com ênfase no entendimento e aplicação;
- Desenvolver habilidades em avaliar modelos econométricos, com respeito aos aspectos estatísticos e econômicos;
- Exercitar o aluno na aplicação de métodos econométricos, através de estudos introdutórios, envolvendo a formulação de modelos, coleta de dados, estimação e interpretação dos resultados.

5. Conteúdo Programático

1. **INTRODUÇÃO À ECONOMETRIA:** Conceitos e objetivos da econometria. Nota histórica. A econometria no Brasil.
2. **CONCEITO E CLASSIFICAÇÃO DE MODELOS:** Conceito de modelo. Classificação de modelos em economia. Modelos econométricos. Classificações úteis dos modelos econométricos. Qualidades desejáveis dos modelos econométricos. Pesquisa econômica e uso de modelos econométricos.
3. **MODELO DE REGRESSÃO LINEAR SIMPLES:** Pressupostos do modelo. Métodos de estimação de modelos. Método dos mínimos quadrados. Análise dos resíduos. Coeficientes beta. Exemplos numéricos da aplicação do modelo de regressão linear simples.
4. **AValiação DE MODELOS ESTIMADOS:** Média, variância e covariância dos parâmetros estimados. Decomposição da soma de quadrados (SQE, SQR e SQT). Estatísticas de avaliação. Análise de variância simples. Variância amostral ou residual. Coeficiente de determinação. Estatística F. Estatística t. Testes de hipótese. Intervalos de confiança.

5. Conteúdo Programático

5. REGRESSÃO E CORRELAÇÃO: Definição do coeficiente de correlação. Relação entre o coeficiente de correlação e de regressão. Diferença entre correlação e regressão. Cálculo das estatísticas de avaliação. Realização de testes de hipóteses e análise de resultados.

6. MODELO DE REGRESSÃO LINEAR MÚLTIPLO: Pressupostos básicos. Estimativa dos parâmetros do modelo. Processos abreviado e longo. Estatísticas de avaliação. Decomposição da soma de quadrados. Definição das estatísticas de avaliação. Variância residual. Coeficiente de determinação ou explicação. Estatística F. Estatística t. Intervalos de confiança. Exemplos numéricos da aplicação do modelo linear geral e de correlação parcial.

6. Procedimentos Pedagógicos / Metodologia

▪ O Curso se desenvolverá sob a forma clássica de aulas expositivas e dialogadas, leituras complementares em sala, trabalhos individuais e em grupo, e apresentação dos trabalhos em forma de seminários tendo como suporte a bibliografia indicada ao final deste programa. Estudo e análise crítica dos textos. Utilizar-se-á, a medida do possível, ilustrações, slides, vídeos, transparências, filmes e demonstrações, durante o desenvolvimento da disciplina.

- É indispensável o uso da calculadora HP 12C.
- Discussões de temática relacionadas à disciplina em sala de aula.
- Construção de textos.

RECURSOS METODOLÓGICOS:

Audiovisual – retro projetor e projetor multimídia, Transparência, Quadro e Pincel, Laboratório de Informática e Biblioteca.

7. Sistemática de Avaliação

Como procedimentos previstos para a avaliação dos alunos podem-se citar: (1) presença; (2) participação e (3) execução das provas individuais ou em grupos com ou sem consulta; (4) seminários; (5) trabalhos escritos e explanados.

As provas terão um peso de 70% (setenta por cento) da nota total do semestre. O aluno realizará 03 (três) provas. O restante da nota 30% (trinta por cento) será completado com atividades, presença e pela qualidade de sua participação nos debates e exercícios em sala de aula; Pelo seu engajamento no curso; Pela qualidade dos trabalhos escritos; pelas provas normativas; criatividade; utilização adequada de idéias e conceitos econômicos e empíricos.

Está previsto um trabalho extra-classe a ser desenvolvido pelos alunos sob a orientação do professor no decorrer do desenvolvimento da disciplina.

O aluno deverá totalizar no mínimo 7,0 (sete) pontos de média final (média das três notas) para ser aprovado, caso não alcance esta pontuação o aluno deverá realizar uma prova substitutiva em relação àquela nota que de menor pontuação. Se, depois da prova substitutiva, o aluno não alcançar a média final, será submetido a uma prova final com todo o conteúdo do semestre no qual ele deverá tirar no mínimo nota 7,0 para ser aprovado.

8. Bibliografia

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

MATOS, Orlando C. **Econometria Básica: Teoria E Aplicações**. 3ª Ed. São Paulo: Atlas, 2000.

GUAJARATI, Damondar N.; **Econometria Básica**. 3ª Ed. São Paulo: Makron Books, 2000.

HOFFMANN, Rodolfo. **Análise de Regressão – Uma Introdução À Econometria**. 3ª Ed. São Paulo: Hucitec, 1998.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

_____. **Estatística Para Economistas**. 3ª Ed. São Paulo: Pioneira, 2001.

LEVIN, Jack. **Estatística Aplicada as Ciências Humanas**. 2ª Ed. São Paulo: Harbra, 1987.

SPIGEL, Murray R. **Estatística**. 3ª Ed. São Paulo: Makron Books, 1993.

VASCONCELLOS, M. A. S., Alves, D. **Manual de Econometria: Nível Intermediário**. São Paulo: Atlas, 2000.

DONAIRe, Denis & Martins, G. De A. **Princípios de Estatística**. 4ª Ed. São Paulo: Atlas, 1998.

PINDYCK, Robert S. **Econometria: modelos e previsões**. Colaboração de Daniel L. Rubinfeld. 4. ed. Rio de Janeiro-RJ: Campus, 2004. 726 p., il. ISBN 85-352-1343-0.

Local

Imperatriz - Maranhão

Nome do Professor

CLAUDIO MARCOS SOUSA MORAES

Data

Fevereiro/2010

Assinatura do Professor