



Curso: Ciências Econômicas | **Código:** ENEX60989 | **Vigência:** 2021/1

Carga Horária: 80 horas

Aulas Semanais:

2 Teóricas/2 Práticas

Etapa: 6

Nome do Componente Curricular:

Estimação de Modelos Econométricos

Ementa:

Mínimos quadrados ordinários e suas diversas formas de regressão. Modelo Linear. Modelo múltiplo. Formas funcionais. Modelos com variáveis qualitativas. Equações simultâneas e modelos especiais.

Objetivo:

Fornecer aos alunos o instrumental para a aplicação de métodos matemáticos e estatísticos à modelagem de problemas da economia, possibilitando a formação de capacidade de elaboração e análise de modelos econômicos simples e intermediários, necessários a análise prática de estudos acadêmicos.

Metodologia/Diretivas:

As aulas serão expositivas e críticas, em laboratório, incluindo leituras, pesquisas, debates e seminários referentes ao conteúdo. Os alunos deverão desenvolver pesquisas, resumos e construir material crítico do tema a ser discutido para debates em sala de aula. Prova para conteúdo teórico.

Avaliação:

Prova individual, trabalhos individuais e em grupo, além de seminários ao longo de cada bimestre.

Conteúdo Programático:

UNIDADE I – REGRESSÃO LINEAR SIMPLES E MÚLTIPLO – CROSS SECTION E TEMPORAL

- 1.1. Hipóteses Clássicas
- 1.2. Método dos Mínimos Quadrados – Fórmulas e Matriz
- 1.3. Estimação
- 1.4. Inferência
 - 1.4.1 Intervalos de confiança dos parâmetros
 - 1.4.2 Teste de hipóteses

UNIDADE II – FORMAS FUNCIONAIS

- 5.1. Modelos básicos
- 5.2. Modelos com variáveis dummy
- 5.3. Modelos de defasagem distribuída



UNIDADE III – EQUAÇÕES SIMULTÂNEAS

- 6.1. Estimação: Mínimos Quadrados Indiretos e Mínimos Quadrados em Dois Estágios
- 6.2. O problema da identificação
- 6.3. Estimação dos parâmetros no caso de superidentificação

Bibliografia Básica:

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. **Introdução à econometria**: uma abordagem moderna. 3. São Paulo Cengage Learning 2018. (Disponível físico e virtual)

GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. **Econometria Básica**. Porto Alegre: AMGH, 2011. (Disponível físico e virtual)

HILL, R. C.; GRIFFITHS, W. E.; JUDGE, G. G. **Econometria**. 2. ed. São Paulo: Saraiva, 2006. (Disponível físico e virtual)

SHRODER, Bruno et. al. **Estatística**: questões comentadas das provas de 2010 a 2019. 7ª ed. Rio de Janeiro: Campus, 2019. Disponível em:
<https://app.minhabiblioteca.com.br/#/books/9788595154513/cfi/6/2!/4/2/2/4@0:0>

Bibliografia Complementar:

PEREDA, P. C., ALVES, D. C. O. **Econometria Aplicada**. Rio de Janeiro: Elsevier, 2018. (Disponível físico e virtual)

MALBOUISSON, Cláudia; FERREIRA TIRYAKI, Gisele (Org.). **Econometria na prática**. Rio de Janeiro: Alta Books, 2017.

VARTANIAN, P. R.; CIA, J. C.; MENDES-DA-SILVA, W. **Econometria**: análise de dados com regressão linear em Excel e Gretl. São Paulo: Saint Paul, 2013.

SARTORIS, A. **Estatística e introdução à econometria**. São Paulo: Saraiva, 2013. (Disponível físico e virtual)

HOFFMANN, Rodolfo. **Análise de regressão**: uma introdução à econometria. 4. ed. São Paulo: HUCITEC, 2006.