

Sumário

CAPÍTULO 1

Introdução à econometria.....	13
1.1 O que é econometria.....	13
1.2 Como ler e usar este livro.....	14
O que este livro é.....	14
O que este livro não é.....	14
Como usar este livro.....	15
1.3 Como este livro está estruturado.....	15

CAPÍTULO 2

Regressão linear e tipos de dados.....	17
2.1 Compreendendo seus dados.....	17
2.2 Tipos de dados.....	17
2.2.1 Dados não métricos.....	17
2.2.2 Dados métricos.....	18
2.3 Preparação dos dados para análise.....	18
2.3.1 Correlação e causalção.....	18

CAPÍTULO 3

Modelo de regressão linear simples: aplicações em Excel e Gretl.....	21
3.1 Modelo de regressão linear simples.....	21
3.2 Propósito da regressão linear simples.....	22
3.3 O modelo de regressão linear simples na planilha eletrônica MS-Excel.....	26
3.3.1 Entendendo a natureza das variáveis do arquivo capitalhumano.xls.....	27
3.3.2 Vamos analisar as candidatas a Miss Acre.....	29
3.3.3 Um pouco de conceitos matemáticos.....	30
3.3.4 Voltando aos dados.....	32
3.3.5 E agora? Como obtemos a equação da reta?.....	32
3.3.6 Instalando o suplemento Análise de Dados do Excel.....	36
3.3.7 Estimando os coeficientes da regressão por Mínimos Quadrados Ordinários (MQO).....	40
3.3.8 O teste t dos parâmetros (intercepto e coeficiente angular).....	42
3.3.9 A ANOVA e o teste F.....	43

3.4	O modelo de regressão linear simples no software Gretl	46
3.4.1	O software Gretl	47
3.4.2	Estimativa de um modelo de regressão linear simples no Gretl	51
3.4.3	Organização do arquivo no Gretl e manuseio dos dados.....	51
CAPÍTULO 4		
	Modelo de regressão linear múltipla: aplicações em Excel e Gretl	63
4.1	Modelo de regressão linear múltipla.....	63
4.2	Pressupostos e diagnóstico das estimativas da regressão linear.....	64
4.2.1	Regressão múltipla padrão.....	65
4.3	O modelo de regressão linear múltipla na planilha eletrônica Excel	66
4.4	Regressão múltipla com Excel	69
4.4.1	Inferência e análise de regressão múltipla pelo Excel	71
4.4.2	ANOVA.....	73
4.4.3	Teste t.....	73
4.5	O modelo de regressão linear múltipla no software Gretl	73
4.5.1	Organização do arquivo no Gretl e manuseio dos dados.....	74
4.5.2	Significância estatística dos coeficientes.....	83
4.5.3	R^2 e R^2 ajustado	83
CAPÍTULO 5		
	Inferências adicionais no modelo de regressão.....	85
5.1	Testes e aspectos adicionais de um modelo de regressão linear	85
5.1.1	Teste de especificação do modelo	85
5.1.2	Teste de heteroscedasticidade – Teste de White.....	87
5.1.3	Teste de normalidade dos resíduos.....	89
5.1.4	Multicolineariedade	91
	Exercícios de aplicação.....	93
	Respostas dos exercícios	99
	Referências.....	103
APÊNDICE		
	Fontes (gratuitas) de dados secundários	105
	Índice remissivo	107