



UNIVERSIDADE FEDERAL DO ESPÍRITO SANTO

Centro de Ciências Jurídicas e Econômicas

Departamento de Ciências Contábeis

Av. Fernando Ferrari, 514 - Campus Universitário - Goiabeiras

CEP. 29075.960 -ES – Brasil- Tel. (27) 4009.2956

Mestrado em Ciências Contábeis

PROGRAMA

Disciplina: ECONOMETRIA BÁSICA	Código:
Professor: Patricia Maria Bortolon	
Carga Horária:	30 horas
Horário:	Período: 2011-2

1. EMENTA:

Modelo de Regressão Linear Clássico, Modelo Normal de Regressão Linear Clássico, Extensões do Modelo de Regressão Linear de Duas Variáveis (regressão pela origem, escalas e unidades de medida, modelos log-lin etc...), Regressão Múltipla, Regressão com Variáveis Binárias, Relaxamento das hipóteses do modelo clássico (multicolinearidade, heterocedasticidade, autocorrelação), Modelos de Escolha Qualitativa (logit, probit, tobit), Regressão com Dados em Pannel, Análise de séries temporais.

2. OBJETIVOS:

- Desenvolver os aspectos conceituais, técnicos, ferramentais e operacionais dos métodos econométricos necessários a realização de pesquisas e elaboração de artigos acadêmicos na área de contabilidade.
- Identificar aplicações das ferramentas econométricas em trabalhos de pesquisa relacionados à sua área de interesse.

3. METODOLOGIA DE ENSINO:

- Aulas expositivas e dialogadas;
- Aulas em laboratório de informática;
- Avaliação de artigos acadêmicos;
- Exercícios individuais e em grupos;

4. AVALIAÇÃO

- Trabalho prático – peso 50% da nota final – elaboração de um texto acadêmico utilizando alguma das técnicas econométricas abordadas no curso. O trabalho envolverá uma pesquisa bibliográfica sobre o tema de interesse, a definição do problema de pesquisa, a escolha e aplicação do método quantitativo.
- Uma prova – peso 50% da nota final

5. REFERENCIAS:

BÁSICA

GUJARATI, D. N. Econometria Básica: 4ª Edição. Rio de Janeiro. Elsevier- Campus, 2006.

COMPLEMENTAR

BISQUERRA, R. , SARRIERA, J. C. E MARTÍNEZ, F. Introdução à Estatística – Enfoque Informático com o Pacote Estatístico SPSS. Porto Alegre: Artmed, 2004.

BOLDRINI, C. e WETZLER, F.; Álgebra Linear. 3ª. ed. São Paulo. Editora Harbra, 1986

BUSSAB, W. O . e MORETTIN, P. A . Estatística Básica. 5ª ed. São Paulo: Saraiva, 2003.

CAMPBELL, J.; LO A.; MACKINLAY, A.;. The Econometrics of Financial Markets. GREENE, W.; Econometric Analysis. Prentice-Hall. 2002

HAMILTON, J.; Time Series Analysis. Princeton University Press, 1994

HAYASHI, F.; Econometrics. Princeton University Press. 2000

LEVINE, D. M., et al. Estatística: Teoria e aplicações, Ed. LTC, Rio de Janeiro, 2008.

STEVENSON, W.J. Estatística aplicada à administração. São Paulo: Harbra, 2001.

SINCICH, T. (1995) Business Statistics by Example, Ed. Prentice-Hall, New Jersey, USA. Princeton, 1996

STEVENSON, W. J. Estatística aplicada à administração. São Paulo: Harper & Row do Brasil, 1981.

WOOLDRIDGE, J.; Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data. MIT Press, 2001