



**UNIVERSIDADE FEDERAL DO ESPÍRITO SANTO**  
Centro de Ciências Jurídicas e Econômicas  
Secretaria Unificada de Pós-Graduação  
Programa de Pós-Graduação em Ciências Contábeis – PPGCON

## **PROGRAMA DE DISCIPLINA**

|                                       |                          |
|---------------------------------------|--------------------------|
| <b>Disciplina:</b> Econometria Básica | <b>Código:</b> PCON 0015 |
| <b>Carga horária:</b> 30 horas        | <b>Créditos:</b> 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).

### **2. OBJETIVOS:**

O curso tem como objetivo proporcionar aos alunos de mestrado em contabilidade uma base nos conceitos fundamentais da econometria aplicada. Os estudantes deverão desenvolver habilidades para especificar, estimar, interpretar e diagnosticar modelos de regressão lineares, utilizando dados reais do campo da contabilidade e área de negócios. Com fundamento teórico e aplicações práticas, o curso preparará os alunos para enfrentar desafios empíricos em suas pesquisas acadêmicas, aplicando métodos econométricos de forma rigorosa e eficiente

### **3. BIBLIOGRAFIA:**

#### Básica

- GUJARATI, D. N. Econometria Básica: 4ª Edição. Rio de Janeiro. Elsevier- Campus, 2006.
- TIRYAKI, Gisele F.; ANDRADE, Cláudia Sá M. Econometria na prática. Rio de Janeiro: Editora Alta Books, 2017.
- HEISS, Florian. Using R for introductory econometrics. CreateSpace Independent Publishing Platform, 2020.

#### Complementar

- WOOLDRIDGE, Jeffrey M. Introdução à econometria: uma abordagem moderna. Cengage Learning, 2023.
- LEVINE, D. M., et al. Estatística: Teoria e aplicações, Ed. LTC, Rio de Janeiro, 5ª. Edição, 2008.
- FÁVERO, L. P; BELFIORE, P. Manual de análise de dados: estatística e machine learning com Excel, SPSS, STATA, R e Python. 2. ed. - Rio de Janeiro: LTC, 2024.
- ANGRIST, D. J.; PISCHKE, Jörn-Steffen. Mostly harmless econometrics. Princeton: Princeton University, 2009.
- 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
- STEVENSON, W.J. Estatística aplicada à administração. São Paulo: Harbra, 2001.

- 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