

EMENTA: Números-Indices. Medidas de Desigualdade. Modelo de Regressão Linear Simples. Series Temporais

1. IDENTIFICAÇÃO DA DISCIPLINA

Código : CNM 5331
Nome : Estatística Econômica e Introdução à Econometria
Nº de Horas/Aula : 04 semanais
Carga Horária : 60 Horas/aula

2. PRÉ-REQUISITO: INE 5116 - Introdução a Estatística

3. IDENTIFICAÇÃO DA OFERTA: Curso de Graduação em Ciências Econômicas

4. OBJETIVOS DA DISCIPLINA

Oferecer um conjunto de conceitos operacionalizáveis aos alunos que capacitem os mesmos ao tratamento estatístico dos dados visando, através da técnicas estatísticas específicas, obterem resultados quantitativos para maior compreensão do comportamento de variáveis e da relação entre as mesmas no ambiente econômico.

5. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

5.1. Números-Indices

- . Diferença entre relativo, percentual e taxas.
- . Relativos de Preço, Quantidade e Valor
- . Propriedade dos índices (identidade, reversibilidade, cíclica ou circular modificada)
- . Series de Números-Indices: base fixa e móvel e mudança de base (elos de relativos e relativos em cadeia)
- . Deflacionamento e suas aplicações: taxa real de juros e poder aquisitivo
- . Construção e análise dos índices agregativos simples (Sauerbeck e Bradstreet)
- . Construção e análise dos índices agregativos ponderados (Laspeyres, Paasche, Fischer, Divisia e Bureau)
- . Alguns índices especiais: índice de custo de vida (IBGE, FIPE, DIEESE, ITAG – Florianópolis), Índice Geral de Preços (FGV), deflator implícito e índice de correção cambial.

5.2. Medidas de Desigualdade

- . Índice de razão de concentração (CR) e índice de Hefindhal-Hirschmann (HH)
- . A Curva de Lorenz e o índice de Gini

5.3. O Modelo de Regressão Linear Simples

- . Estimação e interpretação da regressão: método de mínimos quadrados
- . Coeficientes de Determinação
- . Estimação e interpretação econômica de linearização de funções (exponencial e potência)
- . Modelo estatístico da regressão: conceito e hipóteses
- . Testes de hipóteses e intervalos de confiança
- . Intervalo de previsão

5.4. Series Temporais

- . Avaliação das variações sazonais usando regressão com variáveis binárias (dummies) e através de média móvel.

6. BIBLIOGRAFIA

- FEA (FACULDADE DE ECONOMIA E ADMINISTRAÇÃO). Texto Didático no. 1. Rio de Janeiro, UFRJ. (s/d)
FONSECA, J. S.; MARTINS, G. A. & TOLEDO, G. L. Estatística Aplicada. São Paulo, Atlas, 1988.
GUJARATI, D. Econometria Básica. São Paulo, Mackron Books, 2002.
HOFFMANN, Rodolfo. Estatística para Economistas. São Paulo, Livraria Pioneira Editora, 1980.
MILONI, G. & ANGELINI, F. Estatística aplicada.. Números-índices, regressão e correlação e séries temporais. São Paulo, Atlas, 1995.
SALVATORE, D. Estatística e Econometria. São Paulo, MacGraw-Hill do Brasil, 1983 (xerox).
SCHMIDT, C. A. J.; LIMA, M. L. Índices de concentração. Rio de Janeiro: Secretaria de Acompanhamento Econômico (SEAE), 2002. Disponível em <http://www.fazenda.gov.br/seae/documentos/doctrabalho/docdetrabalho13Final.PDF>
SGRECCIA, Alex; FRANÇA, Caio G; OLIVEIRA, Carlindo R. & FAZZI, João L. Matemática Sindical. Conceitos Úteis à Negociação Coletiva. Belo Horizonte: Escola Sindical & de Outubro – CUT/DIEESE, 1996.

PLANO DE ENSINO

Disciplina: *Estatística Econômica e Introdução à Econometria – CNM5331*

Números de horas: 60 horas – 4 créditos

Professor (a): *Milton Biage*

Ementa: (i) Números-Índices; (ii) Medidas de Desigualdade; (iii) Modelo de Regressão e Linear Simples, e; (iv) Séries Temporais.

OBJETIVOS

GERAL: Oferecer um conjunto de conceitos operacionalizáveis que capacitem os alunos ao tratamento estatístico dos dados, visando através de técnicas estatísticas específicas obterem resultados quantitativos, para maior compreensão do comportamento de variáveis e da relação entre as mesmas no ambiente econômico.

ESPECÍFICOS:

Estabelecer aos alunos:

- Capacidade no uso de software aplicado aos tratamentos estatísticos de dados econômicos;
- Fundamentalmente, aprender analisar e interpretar os resultados obtidos, e;
- Dar ao aluno capacidade para saber fazer, utilizando os conhecimentos estatísticos aprendidos no curso, em disciplinas previamente ensinadas.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

Unidade I: Números-Índices

- Diferença entre relativo, percentual e taxas;
- Relativos de preços, quantidade e valor;
- Propriedade dos índices (identidade, reversibilidade, cíclica ou circular modificada);

- Séries de números-índices: bases fixa e móvel e mudança de base (elos de relativos e relativos de ligação);
- Construção e análise dos índices agregativos simples (Sauerbeck, Bradstreet, Média Geométrica e Média Harmônica);
- Construção e análise dos índices agregativos ponderados (Laspeyers, Paache, Fisher, Divisia, Bureau, etc.);
- Deflacionamento e suas aplicações: taxa real de juros e poder aquisitivo;
- Mudança de base, Deflatores de séries temporais, Deflatores Implícitos de Preço e Índice de Quantum;
- Alguns índices especiais: índices de custo de vida (IBGE, Fipe, DIEESE, etc.), índice geral de preços (FGV), deflator implícito, IBOVESPA e índice de correção cambial;
- Medidas de desigualdades: a curva de Lorenz; índice de Gini; índice de razão de concentração (CR).

Unidade II: Econometria e análise de regressão

- Método científico;
- O que é econometria;
- Tipos de econometria;
- Natureza da Análise de regressão;
- Análise de regressão de duas variáveis: alguns conceitos básicos;
- Exemplo e aplicações;
- Conceitos sobre séries temporais.

Unidade III O Modelo de regressão de duas variáveis e o problema de estimativa

- Construção de um modelo de regressão;
- Dados experimentais observacionais;
- Análise de correlação linear;
- Revisão da concepção de modelos de regressão;

- Considerações sobre o MQO;
- Regressão de duas variáveis: estimativa de intervalos e teste de hipóteses;
- Teste de hipótese: comentários gerais.

BIBLIOGRAFIA

- FONSECA, J. S., MARTINS, G. A. & TOLEDO, G. L. Estatística aplicada. São Paulo, Atlas, 1988 (Capítulos 4 e 5);
- Endo, S. K., 1988, Métodos Quantitativos: números índices, Atual Editora Imtda;
- MILONI, G. & ANGELINI, F. Estatística Aplicada: Números-Índices, Regressão e Correlação e Séries Temporais. São Paulo, Atlas, 1995.
- GUJARATI, D. Econometria Básica. São Paulo, Editora Campus, 2006;
- Pindyck, R. S. e Rubinfeld, D.L.. Econometria: modelos e previsões. 4^a Edição. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004.
- HILL, R. C.; GRIFFITHS, W.E & JUDGE, G.G. Econometria. São Paulo: Saraiva. 2003.
- Stock, James H. e Mark W. Watson. Econometria. São Paulo: Pearson - Addison-Wesley, 2005.
- Wooldridge, Jeffrey M. Introdução à Econometria: Uma Abordagem Moderna. São Paulo: Thomson Learning, 2006.
- KENDALL, M.; STUART, A. The advanced theory of statistics. Londres: Charles Griffin, 1977. v.1.
- Hoffmann, R., 1998, Distribuição de Renda: medidas de desigualdade e pobreza, EDUSP – Editora da Universidade de São Paulo;
- Frank A. Cowell, 2000, Measuring Inequality, Third Edition (material disponível em arquivo pdf);
- João Pedro Azevedo, avaliando a significância estatística da queda na desigualdade no Brasil (material disponível em pdf).

LEMBRETES

1. Os alunos devem lembrar que os tutores e/ou professores estão para auxiliar e não para resolver a lista toda e/ou tarefas.
2. Não serão consideradas as tarefas idênticas feitos por diferentes alunos. O objetivo das tarefas é que o aluno desenvolva o seu próprio raciocínio.

Florianópolis, 10 de 06 de 2010.

Prof. Milton Biage

AVALIAÇÃO

A avaliação da disciplina será composta dos seguintes elementos:

- I. 50% da nota será atribuída às atividades de resumos do conteúdo da matéria e exercícios disponibilizados no ambiente, com data especificada para entrega;
- II. 10% da nota será atribuída às presenças nas videoconferências, conforme comprovante de presença dos tutores dos pólos. Caso estes tutores não envia a lista de presença, então esta nota será zero;
- III. 40% da nota será atribuída à avaliação presencial que os alunos deverão fazer nos pólos.

ORGANIZAÇÃO DO ESTUDO

Entendemos que os alunos deverão realizar um estudo prévio do conteúdo da disciplina a ser apresentado nas videoconferências.

Importante: sabe-se que a disciplina tem a duração média de cinco semanas, sendo que no final desta última semana o aluno fará a prova presencial que encerrará a disciplina. Portanto, é quase obrigatória que o aluno desenvolva estudos diários na disciplina e esteja preparado para a prova no final das videoconferências.

ATENDIMENTO E FÓRUNS

Haverá atendimento permanente durante a execução da disciplina para qualquer esclarecimento sobre o conteúdo via ambiente virtual pelos tutores da UFSC.

- SCHMIDT, C. A. J., LIMA, M. L. *Índices de Concentração*. Rio de Janeiro, Secretaria de Acompanhamento Econômico (SEAE), 2002. Disponível em: <http://www.fazenda.gov.br/seae/documentos/doctrabalho/docdetrabalho13final.PDF>.
- Indicadores econômicos: <http://www.indicadores.hpg.com.br/>
- Índices financeiros brasileiros: <http://www.portalbrasili.eti.br/indices.htm>;
- FIPE – Fundação Instituto de Pesquisas Econômicas: <http://www.fipe.com/>;
- FGV – Fundação Getúlio Vargas: <http://www.fgv.br/ibre/CEP/index.cfm>;
- IBGE – Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística: <http://www.sidra.ibge.gov.br/>;

METODOLOGIA

Aulas por vídeo conferencia: Conforme se sabe, as aulas são concentradas em um conjunto de vídeoconferências. Nestas vídeoconferências serão feitas breves resumos da teoria por meio de imagens texto em WORD e em seguida, a solução de exercício, utilizando os softwares apropriados.

Vídeo Aulas: As vídeos aulas foram preparadas com a finalidade de dar ao aluno uma introdução para o uso de planilhas do Excel e do software GRETL na solução dos problemas típicos da disciplina. Portanto, é sugerido que vejam estas vídeos aulas e anotem as dúvidas, e solicite aos tutores as devidas explicações. Estas aulas encontram-se bastante ilustrativa para uma iniciação no uso destes softwares, contudo, práticas adicionais nos computadores dos núcleos serão efetuadas durante as vídeo conferências, pois durante as aulas serão solicitados aos alunos soluções e práticas de exercícios, os quais farão parte na composição da nota. Portanto, não deixem de solicitar aos seus tutores, especialmente, a instalação do software GRETL, livremente encontrado através do www.google.com.br.