

**UNIVERSIDADE FEDERAL DO
ESPÍRITO SANTO**

PROGRAMA DE DISCIPLINA

DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

DISCIPLINA : ANALISE DE REGRESSÃO II		CÓDIGO : STA 06899
CARGA HORÁRIA SEMANAL :	TEORIA :30	EXERCICIO:30
CARGA HORÁRIA SEMESTRAL: 60h	PERÍODO	CRÉDITOS : 03

EMENTA:

Autocorrelação. Heterocedasticidade. Multicolinearidade. Modelos de Regressão Não-Linear. Modelos Lineares Generalizados. Regressão Robusta.

PROGRAMA:

1. Introdução: Teoria Estatística da Regressão
2. Regressão Múltipla: Revisão (Gujarati, capítulos 7, 8)
 - 2.1. Estimacão
 - 2.2. Inferência Estatística
 - 2.2.1 - Interpretaçãõ dos Coeficientes do Modelo
 - 2.2.2 - Testes de Hipóteses
 - 2.2.3 - Análise dos Resíduos
 - 2.3. Análise de Variância
 - 2.4. Previsão
 - 2.5. Modelos com Variáveis Binárias: Variável Independente Qualitativa (Gujarati, cap. 9)
3. Modelo de Regressão Linear Generalizado (Generalized Linear Regression Model) - (Gujarati, Apêndice C11), Kmenta, capítulo 12)
4. Violação dos Pressupostos Básicos
 - 4.1. Multicolinearidade (Gujarati, capítulo 10)
 - 4.2. Heterocedasticidade (Gujarati, capítulo 11)
 - 4.3. Erros Autocorrelacionados (autocorrelaçãõ serial) - (Gujarati, capítulo 12)
5. Modelos de Regressão Não-Linear (introdução) – (Gujarati, capítulo 14)
6. Regressão Robusta (introdução) – (Montgomery, Pack and Vining, 2006, cap. 11)

LIVRO TEXTO:

Gujarati, Damodar N. (2006), Econometria Básica, Campus, 1a edição, 2006. (Traduzido de Gujarati, Damodar N., Basic Econometrics, 4th edition, Mcgraw Hill, 2004).

Montgomery, Douglas C., Pack, Elizabeth A., Vining, Geoffrey G. (2006), Introduction to Linear Regression Analysis. 4th Edition. Wiley-Interscience.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR:

- Draper, Norman Richard and Smith, Harry Allen (1998), Applied Regression Analysis, 3rd edition, New York, Wiley.

- Greene, William H. (2008) Econometric Analysis, Pearson/Prentice Hall, 6th edition.
- Harvey, A. C. (1990), The Econometric Analysis of Time Series, 2nd Ed., Philip Allan, U.K.
- Johnston, Jack & DiNardo, John (1997), Econometric Methods, 4th Ed., McGraw Hill, New York, (International Student Edition), 531 pag. OBS: Existe uma diferença substancial entre esta edição e as anteriores.
- Kmenta, Jan (2004), Elements of Econometrics, 2nd Edition, The University of Michigan Press.
- Montgomery, Douglas C., Pack, Elizabeth A., Vining, Geoffrey G. (2006), Introduction to Linear Regression Analysis. 4th Edition. Wiley-Interscience.
- Neter, J., W. Wasserman and M.H. Kutner (1985), Applied Linear Statistical Models, 2nd ed., Homewood III.

Assinatura Chefe do Departamento