

PROGRAMA

EMENTA: Variáveis dummy e modelos de defasagens distribuídas. Problemas da análise de regressão: multicolinearidade, heteroscedasticidade, auto correlação e erro nas variáveis. Modelos de equações simultâneas. Especificação, estimação e verificação de modelos econométricos micro e macroeconômicos.

IDENTIFICAÇÃO DA DISCIPLINA

Código : CNM 1240
Nome : Econometria
Nº de Créditos : 04
Carga Horária : 60 horas aula

PRÉ-REQUISITO

Código : CNM 1130
Nome : Estatística e Introdução à Econometria

IDENTIFICAÇÃO DA OFERTA: Curso de Ciências Econômicas

OBJETIVOS DA DISCIPLINA

Complementar o conhecimento de técnicas quantitativas de análise de regressão e teoria da econometria. Fornecer elementos básicos da teoria e aplicação de programação linear.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

- 1- Análise de Regressão Múltipla
 - 1.1. Estimação de Mínimos Quadrados
 - 1.2. Testes de Significância dos Coeficientes
 - 1.3. Coeficientes de Correlação Múltipla Ajustado
 - 1.4. Interpretação da Regressão Estimada
 - 1.5. Uso de Variáveis Dummy
 - 1.6. Aplicações (Funções Lineares e não-Lineares)
- 2- Problemas de Regressão e Técnicas Adicionais
 - 2.1. Multicolinearidade
 - 2.2. Heteroscedasticidade
 - 2.3. Autocorrelação dos Resíduos
 - 2.4. Estimação de Relações Defasadas
 - 2.5. Estimação de Equações Simultâneas
 - 2.6. Aplicações
- 3- Introdução à Programação Linear
 - 3.1. O problema de programação linear e a solução gráfica
 - 3.2. O método simplex
 - 3.3. Formulação de problemas de programação linear
 - 3.4. Análise da solução de problemas de programação linear

BIBLIOGRAFIA

- CHIANG, A. "Matemática para Economistas". São Paulo, McGraw-Hill, 1982.
HOFMANN, R. & VIEIRA, A. "Análise de Regressão: Uma Introdução à Econometria". São Paulo, Hucitec, 1977.
JOHNSTON, J. "Métodos Econométricos". São Paulo, Atlas, 1974.
KELEJIAN, & CATES. "Introdução à Econometria". Rio de Janeiro, Campus, 1978.
KMENTA, J. "Elementos de Econometria". São Paulo, Atlas, 1978.
LANZER, E. A. "Programação Linear: Conceitos e Aplicações". São Paulo, IPEA, 1978.
SALVADOR, D. "Estatística e Econometria". São Paulo, McGraw-Hill, 1980.
WONNACOTT, R. & WONNACOTT, T. "Econometria". São Paulo, Livros Técnicos e Científicos, 1976.

AValiação

A avaliação da disciplina consiste em trabalhos individuais e/ou em grupos aplicados à economia, trabalho final de natureza aplicada e prova final.