

PROGRAMA

EMENTA: Teoria de estimação. Método de máximo e máximo. Regressão simples hipóteses. Estimadores. Teste de hipótese. Coeficiente de determinação. Extensão. Correlação. Regressão. O modelo linear. Estimadores. Testes dos coeficientes. Teoria da Econometria. Multicolinearidade. Asteroscedasticidade. Autocorrelação. Variáveis defasadas. Técnicas especiais. Variáveis auxiliares. Modelos de equações. Noções sobre moc:108. Método de mínimos. Identificação de modelo.

DISCIPLINA: ECONOMETRIA

CÓDIGO: CNM 1243 - Nº DE CRÉDITOS: 05 - Nº AULAS 75 HORAS

1. COMPLEMENTOS DE ESTATÍSTICA

1.1. Conceitos de Probabilidade

V. A. Discreta

V. A. Contínua

1.2. Teoria da Amostragem. Distribuições amostrais

1.3. Teoria da Estimação. Estimativas do intervalo de confiança dos parâmetros populacionais.

1.4. Testes de Hipóteses. Testes que envolvem a distribuição normal.

1.5. Teoria das pequenas amostragens. Distribuição de Student "t" Distribuição do Qui-quadrado.

1.6. Análise de Variância. Distribuição "F".

2. ECONOMETRIA

2.1. Conceitos básicos e objetivos da Econometria.

2.2. O Modelo Linear a duas variáveis:

- Relações entre as variáveis. Introdução à Regressão Simples. A solução de mínimos quadrados. Teoria da Regressão. O modelo matemático. Estimação dos parâmetros da regressão. A média e a variância dos parâmetros. Interpolação. O coeficiente de correlação e o coeficiente de determinação. Análise de Variância.

3. REGRESSÃO MÚLTIPLA

3.1. O modelo Linear Geral:

- Hipóteses do modelo. Estimadores de mínimos quadrados. Testes de significância e intervalos de confiança.

4. TEORIA DA ECONOMETRIA

4.1. Violação das hipóteses do modelo linear geral, multicolineariedade, autocorrelação, heteroscedasticidade.

5. TÉCNICAS ESPECIAIS

5.1. Variáveis Dumy e instrumentais

Bibliografia:

WONNACOTT, Thomas H. e Ronald J. Wonnacott, "Econometria", Livros Técnicos Editora S/A, Rio de Janeiro, 1976.

JOHNSTONS, J. "Métodos Econométricos", Editora Atlas S/A, São Paulo, 1974.

HU TehWei, "Econometria", an Introductory Analysis, University Park Press Baltimore (USA), 1973.

BARBANCHO, A. G. "Econometria" Fundamentos e Possibilidades. Forum Editora, 1970.

Apostila de Multicolinearidade, Heteroscedasticidade, Autocorrelação e Variáveis Defasadas - Faculdade de Economia de São Paulo.