

PROGRAMA

EMENTA: Regressão múltipla. Modelo linear. Hipóteses. Mínimos quadrados ordinários. Testes de significância. Coeficiente de determinação. Violação da hipótese. Heteroscedasticidade. Multicolinearidade. Autocorrelação. Variável instrumental. Variáveis defasadas. Variável "dummy". Equações simultâneas. Modelo Econométrico. Variáveis instrumentais. Mínimos quadrados indiretos. Modelos não lineares.

DISCIPLINA: ECONOMETRIA II

CÓDIGO: CNM 1245 - Nº DE CRÉDITOS: 04 - Nº AULAS 60 HORAS

1. Elementos de álgebra matricial.
  - Matrizes, determinantes, diferenciação de vetores, participação de matrizes.
  - Dependência linear e características, raízes e vetores características.
2. Regressão múltipla
  - Estimadores de mínimos quadrados
  - Testes de significância e intervalos de confiança
3. O modelo linear geral
  - Hipóteses
  - O coeficiente de regressão múltipla
  - Problemas da análise de regressão: multicolinearidade, consequência para efeito de previsão
4. O problema da intercorrelação, consequências em termos das variáveis dos estimadores.
5. Heteroscedasticidade.
6. Problemas na escolha de variáveis, variável omitida, demais variáveis.
7. Técnicas adicionais na análise de regressão múltipla
  - O uso das variáveis
  - A estimação de relações defasadas
  - A transformação logarítmica generalizada
  - Formas polinomiais
8. Sistemas de equações: equações simultâneas
  - Identificação, condição necessária e suficiente - exemplos
  - Variáveis instrumentais
  - Mínimos quadrados indiretos

Bibliografia:

- KMENTA, Jan. Elementos de econometria. Trad. por Carlos Roberto Araújo. São Paulo, Atlas, 1978.
- KELEJIAN-CATES. Introdução à econometria. Trad. por João Luiz Mascolo. Rio de Janeiro, Campus, 1978.
- JOHNSTON, J. Métodos Econométricos. Trad. por Seiki Kaneko Endo. São Paulo Atlas, 1974.
- HOFFMANN, Vieira. Análise de Regressão: uma introdução à econometria. São Paulo, HUCITEC, Editora da USP, 1977.
- WONNACOTT, WONNACOTT. Econometria. Trad. por Maria C. Silva. Rio de Janeiro, Livros Técnicos e Científicos. Editora S.A. 1976
- JAMES-THROSBY. Métodos Quantitativos Aplicados à Econometria. Trad. por Carlos Roberto Araújo. São Paulo, Atlas, 1977.