

Componente Curricular: Econometria I		
<i>Período: 5º</i>	<i>Tipo: Obrigatório</i>	<i>Código: 04185</i>
<i>Carga Horária Total: 60 h</i>		<i>Número de Créditos: 04</i>
<i>Pré-Requisitos: Estatística II</i>		<i>Co-Requisitos: Nenhum</i>
Ementa		
<p>Conceitos básicos da econometria. Modelo de regressão simples: estimação, testes e previsão. Modelo da regressão múltipla. Violações dos pressupostos do modelo clássico linear da regressão: Erros de especificação, Autocorrelação, Heteroscedasticidade, Multicolinearidade. Modelos de escolha qualitativa.</p>		
Conteúdo Programático		
<ul style="list-style-type: none"> ➤ CONCEITOS ECONOMÉTRICOS INTRODUTÓRIOS Definição de economia, econometria e estatística; Tipos de dados; Montagem dos modelos: estocástico <i>versus</i> determinístico; A importância do termo de erro ➤ REGRESSÃO LINEAR SIMPLES Modelo linear; Estatísticas da regressão; Modelos não lineares; Conceitos sobre inferência estatística; Qualidades de um estimador; Inferências sobre o coeficiente angular; Análise de variância; Intervalo de confiança para o valor estimado ➤ REGRESSÃO LINEAR MÚLTIPLA Modelo estatístico de uma regressão linear múltipla; Análise de variância; Intervalo de confiança para a estimativa do valor; ➤ HIPÓTESES DO MODELO CLÁSSICO DE REGRESSÃO LINEAR Ausência de multicolinearidade; Normalidade dos resíduos; Homoscedasticidade Autocorrelação ➤ VIOLAÇÃO DOS PRESSUPOSTOS Multicolinearidade Heteroscedasticidade Autocorrelação ➤ VARIÁVEIS BINÁRIAS ➤ ESTUDOS DE CASOS (TEMAS PROPOSTOS) 		
Referências		
<p>Básicas: GUJARATI, D. N. Econometria básica, São Paulo: Makron Books, 2000. HILL, R. Carter; GRIFFITHS, William E.; JUDGE, George G. Econometria. 2. ed. São Paulo: Saraiva, 2006. xx, 471 p. PINDYCK, Robert S.; RUBINFELD, Daniel L. Econometria: modelos & previsões. Rio de Janeiro: Campus, 2004. xxviii, 726 p.</p> <p>Complementares: KENNEDY, P. A guide to econometrics, Cambridge/Mass.: MIT Press, 1998.</p>		

MADDALA, G.S. **Introdução à econometria**, Rio de Janeiro: LTC, 2003.

VASCONCELOS, M. A. S.e OLIVEIRA, R. G. de,. **Manual de Econometria: Nível Intermediário. São Paulo, Atlas, 2000.**

MUKHERJEE, C.; WHITE, H.; WUYTS, M. **Econometric and Data Analysis for Developing Countries**, London: Routledge, 1998.

SALVATORE, D.; REAGLE, D. Schaum's **outline of theory and problems of statistics and econometrics**, New York et. al.: McGraw-Hill, 2nd. Ed., 2002.