



UNIVERSIDADE FEDERAL RURAL DO RIO DE JANEIRO
PRÓ-REITORIA DE GRADUAÇÃO
CÂMARA DE GRADUAÇÃO
PROGRAMA ANALÍTICO

DISCIPLINA

Código: IS211	ECONOMETRIA I
Créditos: (4T – 0P)	Cada crédito corresponde a 15 horas aula teórica

INSTITUTO DE CIÊNCIAS HUMANAS E SOCIAIS

DEPARTAMENTO DE CIÊNCIAS ECONÔMICAS

OBJETIVOS:

Apresentar o ferramental metodológico econométrico, a fim de fortalecer a formação dos estudantes de Ciências Econômicas do DeCE-UFRRJ na Economia Aplicada, fazendo que o mesmo possa aprender de forma interpretativa, analítica e crítica os modelos de regressão simples e múltipla, bem como, a estimação dos parâmetros. Além apresentar os problemas que violam os pressupostos de MQO (heterocedasticidade, multicolinearidade e autocorrelação serial dos erros) evidenciando quais as consequências destes problemas para os estimadores de MQO.

EMENTA:

Pressupostos do Método de Mínimos Quadrados Ordinários; Modelo de regressão simples e modelo de regressão múltipla. Modelos não lineares, mas intrinsecamente lineares, Variáveis Dummy.; Problemas que violam os pressupostos do estimador de Mínimos Quadrados Ordinários e formas de correções para os problemas.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO:

1. Introdução
 - 1.1. Estrutura dos Dados Econômicos
 - 1.2. Propriedades desejável dos Estimadores
 - 1.3. Inferência Estatística
 - 1.4. Tipos de erro e nível de significância e poder do teste
2. Modelo de Regressão Simples e Aplicações
 - 2.1. Premissas Subjacentes ao Método de Mínimos Quadrados Ordinários
 - 2.2. Teorema de Gauss-Markov
 - 2.3. Média e Variância dos Estimadores de Mínimos Quadrados Ordinários
 - 2.4. Teste de Hipóteses e Intervalo de Confiança
 - 2.5. Estatísticas de qualidade do Ajustamento da Regressão
 - 2.6. Aplicações
3. Modelo de Regressão Múltipla e Aplicações

- 3.1. Estimação.
- 3.2. Coeficientes Padronizados e Elasticidades
- 3.3. Modelos não-lineares intrinsecamente lineares
- 3.4. Variáveis Dummy
- 3.5. Multicolinearidade, consequências e correção
- 3.6. Heterocedasticidade, consequências e correção
- 3.7. Autocorrelação serial, consequências e correção
- 3.8. Não normalidade dos resíduos, consequências e correção

BIBLIOGRAFIA

BÁSICA

GUJARATI, D. N. **Econometria Básica**. 4ª Ed. Rio De Janeiro: Elsevier, 2006. 812p.

HILL, R. Carter; GRIFFITHS, William E; JUDGE, George G. **Econometria**. 2. ed. São Paulo: Saraiva, 2003. 471p

PINDYCK, R. S. E RUBINFELD, D.L. **Econometria: Modelos E Previsões**. 4ª ed. Rio De Janeiro: Elsevier, 2004.

COMPLEMENTAR

HOFFMANN, Rodolfo. **Análise de regressão: uma introdução a econometria**. 3ª Ed. São Paulo: Hucitec. 1998. 379p.

KENNEDY, P. **Manual de econometria**. 6ed. Rio de Janeiro: Elsevier, 2009.

MATOS, Orlando Carneiro de. **Econometria básica: teoria e aplicações**. 2ª Ed. São Paulo: Atlas, 1997. 246p.

MORAIS, A. G. **Estatística para economistas: comentários e exercícios resolvidos para Anpec**. São Paulo: central de ensino para graduados, 2009.

SARTORIS, A. **Estatística E Introdução À Econometria**. São Paulo: Saraiva, 2003.