



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

DISCIPLINA

Código: IS212	ECONOMETRIA II
Créditos: (4T – 0P)	Cada crédito corresponde a 15 horas aula teórica

INSTITUTO DE CIÊNCIAS HUMANAS E SOCIAIS

DEPARTAMENTO DE CIÊNCIAS ECONÔMICAS

OBJETIVOS:

Dar continuidade à preparação do aluno, iniciada em Econometria I, para análise empírica de problemas econômicos através de análise de regressão para modelos para a estimação de modelos multiequacionais bem como de séries de tempo.

EMENTA:

Regressão Linear Múltipla - Problemas de análise de regressão - Equações simultâneas - Aplicações.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO:

1. Modelos de Equações Simultâneas e Econometria de Séries Temporais

- 1.1 Modelos de equações simultâneas
- 1.2 O problema da identificação
- 1.3 Métodos de equações simultâneas
- 1.4 Econometria de séries temporais: alguns conceitos
- 1.5 Econometria de séries temporais: previsão

2. Aplicação Prática dos Conhecimentos

- 2.1. Formulação do Problema.
 - 2.1.1. Identificação do Problema.
 - 2.1.2. Coleta de Dados.
 - 2.1.3. Inserção dos dados em um Pacote Econométrico.
 - 2.1.4. Obtenção dos primeiros resultados: Análise.
 - 2.1.5. Refazendo e corrigindo os erros.

BIBLIOGRAFIA

BÁSICA

BUENO, RODRIGO DE LOSSO DA SILVEIRA. **Econometria de Séries Temporais**. Rio de Janeiro: Cengage Learning, 2ª edição, 2012.

GUJARATI, DAMODAR N.; PORTER, DAWN C. **Econometria Básica**. Porto Alegre: Mc Graw Hill, 5ª edição. 2011.

MORETTIN, PEDRO A.; TOLOI, CLÉLIA M. C. **Análise de Séries Temporais**. Editora Blucher, 2ª edição. 2006.

COMPLEMENTAR:

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.