

PROGRAMA DE ENSINO

EMENTA: Introdução - histórico, conceito e método da Econometria. Análise de Regressão Múltiplas. Problemas de Análise de Regressão. Variáveis "Dummy". Variáveis Defasadas. Modelos de Equações Simultâneas. Aplicações a Economia Catarinense e Brasileira.

I. IDENTIFICAÇÃO DA DISCIPLINA

Código : CNM 5240
Nome : Econometria
Nº de Horas/Aula : 04 semanais
Carga Horária : 72 Horas/aula

2. PRÉ-REQUISITO: Não tem

3. IDENTIFICAÇÃO DA OFERTA: Curso de Graduação em Ciências Econômicas

4. OBJETIVOS DA DISCIPLINA

Oferecer aos alunos um conjunto sistematizado de proposições conceituais e de modelos de aplicação que os capacite satisfatoriamente para o tratamento quantitativo e a interpretação de modelos econômicos e econométricos.

5. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

5.1. Introdução

- . Histórico, Conceito e Método da Econometria - e suas relações com outras ciências.
- . Modelos Econômicos e Econométricos
- . Aplicações e Limitações da Econometria

5.2. Análise de Regressão Múltipla

- . O Modelo de Regressão Linear Múltipla
- . Estimadores de Mínimos Quadrados
- . Testes de Significância - dos Coeficientes e Global da Regressão
- . Análise de Variância com Melhoria
- . Coeficientes de Determinação Múltipla, de Determinação Múltipla Ajustado e de Correlação Parcial
- . Especificação, Estimação, Teste e Verificação de Modelos Aplicados as Economias Catarinenses e Brasileira

5.3. Problemas e Técnicas Adicionais da Análise de Regressão

- . Multicolinearidade, Heteroscedasticidade, Autocorrelação e Erros nas Variáveis
- . Variáveis "Dummy"
- . Estimação de Relações Defasadas
- . Estimamos de Equações Simultâneas
- . Especificação, Estimação, Teste e Verificação de Modelos Aplicados as Economias Catarinenses e Brasileira

5.4. Tópicos Especiais em Economia

6. BIBLIOGRAFIA

6.1. Bibliografia Obrigatória

SALVATORE, Dominick. Estatística e Econometria. São Paulo, MacGraw-Hill do Brasil, 1983.

JOHNSTON, J. Métodos Econométricos. São Paulo, Atlas, 1974.

BARBANCHO, A. G. Fundamentos e Possibilidades da Econometria. Rio de Janeiro, Forum Ed., 1970.

6.2. Bibliografia Complementar

HOFFMAN, R. & VIEIRA, S. Análise de Regressão: Uma Introdução a Econometria. São Paulo, Hucitec, 1977.

KELEJIAN, H.H. & OATES, W. E. Introdução a Econometria - princípios e aplicações. RJ, Campus, 1978.

KMENTA, J. Elementos de Econometria. São Paulo, Atlas, 1978.

WONNACOTT, R. J. & WONNACOTT, T.H. Econometria. São Paulo, Livros Técnicos e Científicos, 1976.

BARBANCHO, A.G. Complementos de Econometria. Barcelona, Espanha, Ediciones Ariel, 1962.

CRAMER, J.S. Econometria Empírica. México, Fondo de Cultura Econômica, 1981.

FOX, K. Manual de Econometria. Buenos Aires, Amorrortu editores, 1973.

FONSECA, Jairo Simon da et alii. Estatística Aplicada. São Paulo, Atlas, 1988.

BARBOSA, F.H. Microeconomia: Teoria, Modelos Econométricos e Aplicações a Economia Brasileira. Rio de Janeiro, IPEA/INPES, 1985.