

MINISTÉRIO DA EDUCAÇÃO  
UNIVERSIDADE FEDERAL DE SANTA CATARINA  
CENTRO SÓCIO - ECONÔMICO  
DEPARTAMENTO DE CIÊNCIAS ECONÔMICAS

PROGRAMA DE ENSINO

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

I. IDENTIFICAÇÃO DA DISCIPLINA

Código	: CNM 5241
Nome	: Econometria
Nº de Horas/Aula	: 04 semanais
Carga Horária	: 60 Horas/aula

2. PRÉ-REQUISITO: Código/Nome: CNM 5331 – Estatística Econômica e Introdução à Econometria

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 econometríticos.

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

Bibliografia

BARBANCHO, A.G., 1970, Capítulos I, II, VII e VIII.

HILL et alli, 2003. Cap. 1.

GUJARATI, 2000. Cap. 1.

5.2. Analise de Regressão Múltipla

- . O Modelo de Regressão Linear Múltipla
- . Estimadores de Mínimos Quadrados
- . Testes de Significância - dos Coeficientes e Global da Regressão
- . Analise de Variância com Melhoramento
- . 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

Bibliografia

SALVATORES, D., 1983, Cap. 7.

JOHNSTON, J., 1974, Cap. 4.

HILL et alli, 2003. Caps. 3 a 7.

GUJARATI, 2000. Caps. 2 a 8.

5.3. Problemas e Técnicas Adicionais da Analise de Regressão

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

Bibliografia

SALVATORE, D., 1983, Capítulos 8 a 10.

JOHNSTON, J., 1974, Capítulos 6 a 10.

HILL et alli, 2003. Caps. 9 a 12.

GUJARATI, 2000. Caps. 10 a 13.

## 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, Fórum Ed., 1970.

HILL,, R. Carter; GRIFFITHS, William & JUDGE, George. Econometria. Tradução: Alfredo Alves de Farias. São Paulo: Saraiva, Set alli, 2003

GUJARATI, Damodar. Econometria Básica. São Paulo: Makron Books. 2000.

### 6.2. Bibliografia Complementar

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

KELEJIAN, H.H. & OATES, W. E. Introdução a Econometria - princípios e aplicações. Rio de Janeiro, 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, España, 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.



Documento assinado digitalmente

Carlos Alberto do Espírito Santo Junior

Data: 05/07/2021 12:31:04-0300

CPF: 116.318.987-10

Verifique as assinaturas em <https://v.ufsc.br>