

DISCIPLINA: **ECONOMETRIA I**

CARGA HORÁRIA: **60h**

PRÉ-REQUISITO: ESTATÍSTICA ECONÔMICA E INTRODUÇÃO À ECONOMETRIA

PERÍODO: **5º**

CÓDIGO: **IEE233**

OBJETIVO

Apresentar os fundamentos da modelagem estatística de fenômenos econômicos, enfocando, basicamente, os modelos lineares. Conceitos e modelos considerados em Estatística II são, num sentido, particularizados para processos de natureza econômica e, noutro, generalizados de forma a acomodar relações de dependência entre as variáveis.

EMENTA

Tópicos especiais no modelo de regressão linear: Estimação com restrições lineares; variáveis Dummy; multicolinearidade; introdução à teoria assintótica. Heterocedasticidade: melhor estimador linear não tendencioso; método iterativo; testes de homocedasticidade. Modelo Auto-regressivo de primeira ordem: Estimação: melhor estimador linear não tendencioso; método iterativo; Durbin-Watson. Modelo de Regressão Linear Generalizado: estimador de mínimos quadrados generalizados (Aitken); estimação consistente: alguns casos especiais. Modelo de Equações Aparentemente não relacionadas: estimação; testes para correlação contemporânea; testes de restrições lineares nos coeficientes.

BIBLIOGRAFIA

GUJARATI D.N., *Econometria Básica*, Makron Books, 2000;
CARTER HILL, R. et alii, *Econometria*, Saraiva, 1999;
KMENTA, J. *Elementos de Econometria*, vol.2. Ed. Atlas.
GRIFFITHS, HILL, JUDGE. *Learning and Practicing Econometrics*. John Wiley & Sons.
JOHNSTON J. *Econometric Methods*. McGraw-Hill.