



UNIVERSIDADE FEDERAL DE SANTA CATARINA
CENTRO SOCIOECONÔMICO
DEPARTAMENTO DE ECONOMIA E RELAÇÕES INTERNACIONAIS

PROGRAMA DE ENSINO

EMENTA:

Tipos de dados econômicos, causalidade e a noção de ceteris paribus na Econometria. Regressão múltipla: mecânica e interpretação das estimativas de MQO; valor esperado e variância dos estimadores de MQO; eficiência e o teorema de Gauss-Markov; distribuições amostrais dos estimadores de MQO, testes de hipóteses e intervalos de confiança sobre um único parâmetro e sobre combinações lineares destes - os testes t e F. Consistência, eficiência e normalidade assintótica do estimador de MQO. Inferência em grandes amostras. Heterocedasticidade, autocorrelação e suas consequências para o método MQO. Inferência robusta. Modelos para escolha discreta. Introdução a séries temporais.

1. IDENTIFICAÇÃO DA DISCIPLINA:

Código: CNM 6015

Nome: Econometria

Créditos: 04

Carga Horária: 72h

2. PRÉ-REQUISITOS:

CNM6011 - Estatística Econômica ou CNM7331 - Estatística Econômica.

3. IDENTIFICAÇÃO DA OFERTA:

Curso de Graduação em Ciências Econômicas.

4. OBJETIVOS DA DISCIPLINA:

Apresentar as técnicas básicas para análise econométrica e aplicar tais técnicas a problemas econômicos.

5. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO:

1. DADOS, PERGUNTAS ECONÔMICAS PREVISÕES E CAUSALIDADE.

2. REVISÃO DE PROBABILIDADE, ESTATÍSTICA E REGRESSÃO SIMPLES.

3. VIÉS DE VARIÁVEIS OMITIDAS E A NECESSIDADE DA REGRESSÃO MÚLTIPLA.

4. FUNDAMENTOS DA ANÁLISE DE REGRESSÃO MÚLTIPLA.

6. BIBLIOGRAFIA:

Bibliografia básica:

GUJARATI, D. Econometria Básica. São Paulo, Editora Campus, 2006.

STOCK, J., WATSON, M. Econometria. São Paulo, Editora Pearson, 2004.

WOOLDRIDGE, J. Introdução a Econometria. São Paulo, Editora Cengage Learning, 2010.

Bibliografia complementar:

BUENO, R.L.S. Econometria de Séries Temporais. 2ª edição, São Paulo: Cengage Learning, 2011.

HILL, R. Carter, GRIFFITHS, William E, JUDGE, George G. Econometria. 2ª edição, São Paulo: Saraiva, 2003.

HOFFMANN, Rodolfo. Análise de Regressão: Uma Introdução à Econometria. 4ª edição, São Paulo: Hucitec, 2006.

MATOS, O.C. de. Econometria Básica: teoria e aplicações. São Paulo: Atlas, 2000.

PINDYCK, Robert S, RUBINFELD, Daniel L. Econometria: modelos e previsões. Rio de Janeiro: Campus, 2004.