



UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA
PRÓ REITORIA DE ENSINO
DIRETORIA DE REGISTRO ESCOLAR

Programa Analítico de Disciplina

ECO450 Econometria I

Departamento de Economia - Centro de Ciências Humanas, Letras e Artes

Número de créditos: 4		<u>Teóricas</u>	<u>Práticas</u>	<u>Total</u>
Duração em semanas: 15	Carga horária semanal	3	1	4
Períodos - oferecimento: I e II	Carga horária total	45	15	60

Pré-requisitos (Pré ou co-requisitos)*

EST105

Ementa

Aulas de Laboratório: Estimção da relação das variáveis econômicas. Aplicação de modelos vistos ao longo dos cursos. Aulas de Laboratório: Interpretação estatística e econômica dos resultados estimados. Aulas de Laboratório: correção prática de violações estatísticas dos modelo propostos. Origem histórica. Teoria econômica e empirismo. O problema da estimção. Testes de hipóteses e predição. Análise da regressão múltipla. O modelo de regressão linear geral. Violações dos pressupostos básicos. Variáveis binárias ou dummy. Modelos de Equações Simultâneas.

Oferecimento aos Cursos

Curso	Modalidade	Período
Ciências Econômicas(CEN)	Obrigatória	6
Ciências Econômicas(CEG)	Obrigatória	6



UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA
PRÓ REITORIA DE ENSINO
DIRETORIA DE REGISTRO ESCOLAR

ECO450 Econometria I

Seq	Aulas Teóricas	Horas/Aula
1	Origem histórica 1.1. Introdução 1.2. Interpretação moderna 1.3. Estatística e dependência funcional 1.4. Regressão x correlação 1.5. Terminologia e notação	2
2	Teoria econômica e empirismo 2.1. Modelo para estimação de variáveis econômicas 2.2. O conceito de regressão da população 2.3. A natureza do termo estocástico e função de regressão amostral	2
3	O problema da estimação 3.1. Regressão simples. 3.2. O método dos mínimos quadrados ordinários 3.3. Propriedades dos estimadores de mínimos quadrados 3.4. O coeficiente de determinação 3.5. Análise de correlação 3.6. Funções que se tornam lineares por transformação	7
4	Testes de hipóteses e predição 4.1. Estimação do intervalo de confiança para os parâmetros e testes de hipóteses 4.2. Análise de variância para a regressão 4.3. O problema da predição	4
5	Análise da regressão múltipla 5.1. Um modelo de três variáveis 5.2. Notação e suposições 5.3. Interpretação e equação de regressão 5.4. O coeficiente de determinação e os coeficientes de regressão múltipla e parcial 5.5. Análise de variância	8
6	O modelo de regressão linear geral 6.1. O modelo de regressão linear geral 6.2. Notação matricial 6.3. Estimação 6.4. Coeficiente de determinação	8



UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA
PRÓ REITORIA DE ENSINO
DIRETORIA DE REGISTRO ESCOLAR

	6.5. A matriz de correlação	
7	Violações dos pressupostos básicos 7.1. Multicolinearidade 7.1.1. Natureza, consequências, detecção e possível correção 7.1.2. Multicolinearidade e predição 7.2. Heteroscedasticidade 7.2.1. Natureza, consequências, detecção e métodos de correção 7.3. Autocorrelação 7.3.1. Natureza, consequências, detecção e métodos de correção	8
8	Variáveis binárias ou dummy 8.1. Natureza e aplicação da variável dummy; seu uso em análise sazonal	2
9	Modelos de Equações Simultâneas 9.1. A natureza de Equações Simultâneas 9.2. Viés de simultaneidade 9.3. Problema de identificação em equações simultâneas 9.4. Método de Mínimos Quadrados em Dois Estágios (MQ2E)	4



**UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA
PRÓ REITORIA DE ENSINO
DIRETORIA DE REGISTRO ESCOLAR**

ECO450 Econometria I

ECO450 Econometria I

Seq	Aulas Práticas	Horas/Aula
1	Aulas de Laboratório: Estimação da relação das variáveis econômicas. Aplicação de modelos vistos ao longo dos cursos.	4
2	Aulas de Laboratório: Interpretação estatística e econômica dos resultados estimados	6
3	Aulas de Laboratório: correção prática de violações estatísticas dos modelo propostos	5



**UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA
PRÓ REITORIA DE ENSINO
DIRETORIA DE REGISTRO ESCOLAR**

ECO450 Econometria I

Referências Bibliográficas

Bibliografia Básica:

- 1 - GUJARATI, Domodar. Basic econometrics. 2 ed. Mc Graw Hill. [Exemplares disponíveis: 11]
- 2 - PINDYCK, R.S. RUBINFELD, D.L. Econometria: modelos & previsões. Tradução da quarta edição. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004. [Exemplares disponíveis: 13]

Bibliografia Complementar:

- 3 - SARTORIS, A. Estatística e introdução à econometria. São Paulo: Saraiva, 2003. [Exemplares disponíveis: 2]
- 4 - STOCK, J.H.; WATSON, M.W. Econometria. São Paulo: Pearson Education. 2004. [Exemplares disponíveis: 1]
- 5 - VASCONCELLOS, M.A.S.; ALVES, D. (editores). Manual de econometria. São Paulo: Atlas, 2000. [Exemplares disponíveis: 1]