



UNIVERSIDADE FEDERAL DE PERNAMBUCO
PRÓ-REITORIA PARA ASSUNTOS ACADÊMICOS
DIRETORIA DE DESENVOLVIMENTO DO ENSINO

PROGRAMA DE COMPONENTE CURRICULAR

TIPO DE COMPONENTE (Marque um X na opção)

<input checked="" type="checkbox"/> Disciplina <input type="checkbox"/> Atividade complementar <input type="checkbox"/> Trabalho de Conclusão de Curso - TCC	<input type="checkbox"/> Prática de Ensino <input type="checkbox"/> Módulo <input type="checkbox"/> Trabalho de Graduação
--	---

STATUS DO COMPONENTE (Marque um X na opção)

<input checked="" type="checkbox"/> OBRIGATÓRIO	<input type="checkbox"/> ELETIVO	<input type="checkbox"/> OPTATIVO
---	----------------------------------	-----------------------------------

DADOS DO COMPONENTE

Código	Nome	Carga Horária Semanal		Nº. de Créditos	C. H. Global	Período
		Teórica	Prática			
ECON 0015	Econometria	4	0	4	60	5º

Pré-requisitos	ECON0029 ECON0033	Co-Requisitos		Requisitos C.H.	
----------------	----------------------	---------------	--	-----------------	--

EMENTA

Modelo linear generalizado. Quebra das importes estruturais: autocorrelação, heterocedasticidade e multicolinearidade. Transformação de Box-Cox. Regressão não-linear. Regressão de variáveis qualitativas. Séries temporais.

OBJETIVO (S) DO COMPONENTE

GERAL:

Desenvolver habilidades que permitam ao estudante o uso de modelos econométricos.

ESPECÍFICOS:

- Estudar o Modelo de Mínimos Quadrados e o Teorema de Gauss Markov;
- Fornecer subsídios para aplicação de modelos de regressão composta;
- Preparar o aluno para utilizar pacotes econométricos mais avançados, principalmente o SPSS.

METODOLOGIA

Aulas expositivas, utilizando-se o quadro, retroprojektor ou data-show. Exercícios em sala e corrigidos.

AValiação

Avaliação constante do desenvolvimento do conhecimento do aluno e duas avaliações formais.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

10. Modelo econométrico objetivo, construção e a importância no processo da construção do conhecimento; tipos de variáveis e tipos de dados.
11. Modelo linear com k variáveis.
 - a. Formulação algébrica dos mínimos quadrados-MMQ
 - b. Equação na forma de desvio
 - c. Geometria dos MMQ
12. Inferência na equação com k variáveis e Teorema de Gauss-Markov.
13. Quebra dos pressupostos.
 - d. Multicolinearidade
 - e. Heterocedasticidade
 - f. Autocorrelação
14. Regressão não-linear estimador de máxima verossimilhança.
15. Transformação Box-Cox.
16. Regressão com variáveis qualitativas.
17. Séries temporais.



BIBLIOGRAFIA BÁSICA

GUJARATI, D. Econometria Básica. Rio de Janeiro: Campus, 2006.

JOHNSTON, J. & DINARDO, J. Métodos Econométricos. Lisboa: McGraw Hill, 2001.

MADDALA, G.S. Introdução à Econometria. Rio de Janeiro: LTC-Livros Técnicos e Científicos Editora S.A., 2003.

PINDYCK, R.S.; RUBINFELD, D. L. Econometria. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

DEPARTAMENTO A QUE PERTENCE O COMPONENTE

NÚCLEO DE GESTÃO

Prof. Antônio César Cardim Britto

ASSINATURA DO CHEFE DO DEPARTAMENTO

Prof. Antônio César Cardim Britto
Coordenador do Núcleo de Gestão
SIAPE 1324019



HOMOLOGADO PELO COLEGIADO DE CURSO

ECONOMIA

Prof. Lucilena F. Castanheira Corrêa

ASSINATURA DO COORDENADOR DO CURSO OU ÁREA



Prof.ª Lucilena F. Castanheira Corrêa
SIAPE Nº1796244
Coordenadora do Curso de
Ciências Econômicas
UFPE/CAA