



**UNIVERSIDADE FEDERAL FLUMINENSE
CENTRO DE ESTUDOS SOCIAIS APLICADOS
INSTITUTO DE CIÊNCIAS DA SOCIEDADE E DESENVOLVIMENTO REGIONAL**

**ANEXO 1 – DISCIPLINAS DO CURSO DE GRADUAÇÃO EM CIÊNCIAS
ECONÔMICAS**

IDENTIFICAÇÃO:

Disciplina (nome): ECONOMETRIA I

Característica: Obrigatória Optativa

Período: 4º

CARGA HORÁRIA SEMESTRAL: |_6_|_0_| horas

CARGA HORÁRIA ANUAL: | | | horas

Pré-requisito: Estatística

OBJETIVO: Propiciar aos alunos o primeiro contato com a econometria, trabalhando conceitos, modelos e técnicas econométricas. Ao término do curso, espera-se que o estudante seja capaz de estimar, analisar e interpretar os modelos de regressão linear nas suas mais diversas formas.

EMENTA: Regressão da população. Regressão amostral. Regressão simples. Método dos Mínimos Quadrados Ordinários (MQO). Propriedades dos estimadores de mínimos quadrados. Testes de hipóteses e predição. Formas funcionais dos modelos de regressão. Análise da regressão múltipla: estimação e inferência.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO:

1. **Introdução à econometria**
 - 1.1. O que é econometria
 - 1.2. Metodologia da pesquisa econométrica
 - 1.3. Natureza e tipos de dados econômicos
2. **Análise de regressão**
 - 2.1. Regressão simples
 - 2.2. O método dos Mínimos Quadrados Ordinários (MQO)
 - 2.3. Propriedades dos estimadores de mínimos quadrados
 - 2.4. O coeficiente de determinação
 - 2.5. Funções que se tornam lineares por transformação
3. **Inferência estatística**
 - 3.1. Distribuição de probabilidade dos termos de erro
 - 3.2. Estimação do intervalo de confiança para os parâmetros e testes de hipóteses
 - 3.3. Análise de variância para a regressão



**UNIVERSIDADE FEDERAL FLUMINENSE
CENTRO DE ESTUDOS SOCIAIS APLICADOS
INSTITUTO DE CIÊNCIAS DA SOCIEDADE E DESENVOLVIMENTO REGIONAL**

4. **Extensões do modelo de regressão simples**
 - 4.1. Modelo log-linear
 - 4.2. Modelo log-lin
 - 4.3. Modelo lin-log
 - 4.4. Modelos recíprocos
5. **Análise da regressão múltipla: O problema da estimação**
 - 5.1. Um modelo de três variáveis: notação e premissas
 - 5.2. Interpretação da equação de regressão múltipla
 - 5.3. Significado dos coeficientes de regressão parciais
 - 5.4. O coeficiente de determinação múltiplo
 - 5.5. O coeficiente de correlação parcial
6. **Análise da regressão múltipla: o problema da inferência**
 - 6.1. Premissa da normalidade do termo de erro
 - 6.2. Teste de hipótese com relação aos coeficientes de regressão individuais
 - 6.3. Teste de significância geral
 - 6.4. Teste da igualdade de dois coeficientes de regressão
 - 6.5. Teste das restrições de igualdade linear
 - 6.6. Teste de Chow

MÉTODO DE AVALIAÇÃO: Provas e trabalhos

BIBLIOGRAFIA BASICA:

GUJARATI, D. **Econometria básica**. 4ª. Edição. São Paulo: Editora Campus, 2006. 812p.

HILL, C., GRIFFITHS, W., JUDGE, G. **Econometria**. 2. ed. São Paulo: Saraiva, 2003. 471 p.

WOOLDRIDGE, J. M. **Introdução à Econometria**: Uma Abordagem moderna; São Paulo: Thomson Learning, 2005.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR:

KMENTA, J. **Elementos de econometria**. São Paulo: Atlas, 1978

HOFFMAN, R.; VIEIRA, S. **Análise de regressão: uma introdução à econometria**. São Paulo: Hucitec, 1977. 339 p.

PINDYCK, R.S.; RUBINFELD, D.L. **Econometria**: Modelos e Previsões. 4 ed. Rio de Janeiro: Campus, 2004. 760 p.



**UNIVERSIDADE FEDERAL FLUMINENSE
CENTRO DE ESTUDOS SOCIAIS APLICADOS
INSTITUTO DE CIÊNCIAS DA SOCIEDADE E DESENVOLVIMENTO REGIONAL**

--