



**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 II

Característica: Obrigatória Optativa

Período: 5º

CARGA HORÁRIA SEMESTRAL: |_6_|_0_| horas

CARGA HORÁRIA ANUAL: | | | horas

Pré-requisito: Econometria I

OBJETIVO: Apresentar e Trabalhar as extensões da análise de regressão de modo a ampliar os conhecimentos dos alunos em termos de modelos econométricos, dando ênfase a interpretação e aplicabilidade aos problemas econômicos.

EMENTA: Violações dos pressupostos básicos: Multicolinearidade, Heterocedasticidade e Autocorrelação. Abordagem matricial para modelos de regressão múltipla. Variáveis binárias. Estimação por máxima verossimilhança. Modelos de escolha qualitativa: MPL, Logit, Probit e Tobit.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

1. **A Abordagem matricial para o modelo de regressão linear**
 - 1.1. O modelo de regressão linear com k variáveis
 - 1.2. Premissas do modelo de regressão linear clássico em notação matricial
 - 1.3. Estimação por mínimos quadrados ordinários (MQO)
2. **Modelos de Regressão com Variáveis Binárias (*Dummies*)**
 - 2.1. A natureza das variáveis binárias
 - 2.2. Modelos ANOVA
 - 2.3. Modelos ANOVA com duas variáveis qualitativas
 - 2.4. Regressões com variáveis qualitativas e quantitativas
 - 2.5. Variáveis binárias: teste de quebra estrutural
 - 2.6. Variáveis *Dummies*: Análise Sazonal
3. **Violações dos pressupostos básicos**
 - 3.1. Multicolinearidade
 - 3.2. Natureza, consequências, detecção e possível correção



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

- 3.3. Heteroscedasticidade
- 3.4. Natureza, consequências, detecção e métodos de correção
- 3.5. Autocorrelação
- 3.6. Natureza, consequências, detecção e métodos de correção
- 4. **Método da máxima verossimilhança**
 - 4.1. Introdução
 - 4.2. Função densidade de probabilidade
 - 4.3. Estimacão de máxima verossimilhança
 - 4.4. Aplicacão
- 5. **Modelos de escolha qualitativa**
 - 5.1. Modelo de Probabilidade Linear (MPL)
 - 5.2. Modelo Logit
 - 5.3. Modelo Probit
 - 5.4. Modelo Tobit

MÉTODOS DE AVALIAÇÃO: Provas e trabalhos

BIBLIOGRAFIA BÁSICA:

GUJARATI, D. **Econometria básica**. 4ª. Edicão. 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.