



UNIVERSIDADE FEDERAL DE SANTA MARIA - UFSM
PROGRAMA DE DISCIPLINA



DEPARTAMENTO:

06.32 - DEPTO. CIÊNCIAS ECONÔMICAS - CIE

IDENTIFICAÇÃO DA DISCIPLINA:

CÓDIGO	NOME	(T - P)
CIE1048	ECONOMETRIA	(2 - 2)

OBJETIVOS – ao término da disciplina o aluno deverá ser capaz de:

Avaliar e corrigir problemas de relaxamento de hipóteses do modelo linear clássico. Compreender e utilizar de variáveis dummies e defasadas. Identificar e estimar modelos de equações simultâneas. Analisar séries temporais.

PROGRAMA:

TÍTULO E DESCRIMINAÇÃO DAS UNIDADES

UNIDADE 1 - RELAXAMENTO DE HIPÓTESES DO MODELO CLÁSSICO

- 1.1 Multicolinearidade.
- 1.2 Heteroscedasticidade.
- 1.3 Autocorrelação.
- 1.4 Erros de especificação.

UNIDADE 2 - TÓPICOS EM ECONOMETRIA

- 2.1 Variáveis dummies.
- 2.2 Modelos auto-regressivos e de defasagem distribuída.

UNIDADE 3 - SISTEMAS DE EQUAÇÕES SIMULTÂNEAS

- 3.1 - Modelos de equações simultâneas.
- 3.2 - O problema da identificação.
- 3.3 - Métodos de equações simultâneas.

UNIDADE 4 - SÉRIES TEMPORAIS

- 4.1 Processo estacionário estocástico.
- 4.2 Testes de estacionariedade.
- 4.3 Co-integração.
- 4.4 Modelos ARMA e ARIMA.

BIBLIOGRAFIA

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

- GUJARATI, Damodar N. **Econometria básica**. 3. Ed. São Paulo: Makron Books. 2000.
HOFFMAN, R. e VIEIRA, S. **Análise de regressão: uma introdução à econometria**. São Paulo: Hucitec. 1987.
KMENTA, Jan. **Elementos de econometria**. SP: Atlas. 1978.
BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR
HILL, R.C. GRIFFITHS, W.E., JUDGE, G.G. **Econometria**. São Paulo: Saraiva. 1999.
JOHNSTON, J. **Econometric methods**. Singapore: McGraw-Hill. 1991.
_____. **Métodos econométricos**. São Paulo: Atlas. 1986.
MATOS, O.C.de. **Econometria Básica. Teoria e Aplicações**. São Paulo: Atlas. 1997.

Data : ____/____/____

P/ DERCA



UNIVERSIDADE FEDERAL DE SANTA MARIA - UFSM
PROGRAMA DE DISCIPLINA



DEPARTAMENTO:

06.32 - DEPTO. CIÊNCIAS ECONÔMICAS - CIE

IDENTIFICAÇÃO DA DISCIPLINA:

CÓDIGO	NOME	(T - P)
CIE1048	ECONOMETRIA	(2 - 2)

OBJETIVOS – ao término da disciplina o aluno deverá ser capaz de:

Avaliar e corrigir problemas de relaxamento de hipóteses do modelo linear clássico. Compreender e utilizar de variáveis dummies e defasadas. Identificar e estimar modelos de equações simultâneas. Analisar séries temporais.

PROGRAMA:

TÍTULO E DESCRIMINAÇÃO DAS UNIDADES

STOCK, James H. WATSON, Mark W. **Econometria**. São Paulo: Addison Wesley. 2004.
WONNACOTT, Ronald J. WONNACOTT, Thomas. **Econometria**. Rio de Janeiro: Livros Técnicos e Científicos. 1976

Data : ____/____/____

P/ DERCA