

**UNIVERSIDADE FEDERAL DO  
ESPÍRITO SANTO**

**PROGRAMA DE DISCIPLINA**

**DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA**

DISCIPLINA : <b>INTRODUÇÃO A ECONOMETRIA</b>			CÓDIGO : <b>STA 02396</b>
CARGA HORÁRIA SEMANAL :	TEORIA :	EXERCÍCIO:	LABORATÓRIO :
CARGA HORÁRIA SEMESTRAL: <b>60h</b>	PERÍODO :		CRÉDITOS : <b>03</b>

**EMENTA:**

Modelo Linear Geral - Variáveis Binárias - Números Índices - Aplicações à Econometria dos Modelos Lineares - Modelos de Equações Simultâneas - Identificação e Estimação.

**PROGRAMA:**

1. INTRODUÇÃO
  - 1.1 Definição e campo de aplicação
  - 1.2 Histórico da econometria
  - 1.3 Metodologia da econometria
2. MODELO LINEAR CLÁSSICO
  - 2.1 Estimação Pontual
  - 2.2 Intervalos de Confiança
  - 2.3 Testes de Hipóteses
  - 2.4 Enfoque Matricial
3. VIOLAÇÃO DOS PRESSUPOSTOS DO MODELO CLÁSSICO
  - 3.1 Multicolinearidade
  - 3.2 Heterocedasticidade
  - 3.3 Autocorrelação e não Normalidade
4. TÓPICOS EM ECONOMETRIA
  - 4.1 Modelos Auto-Regressivos
  - 4.2 Modelos de Defasagem Distribuídas
  - 4.3 Regressão com Variáveis “DUMMY”
  - 4.4 Mínimos Quadrados Generalizados e de dois estágios
  - 4.5 Transformação de Box-Cox
5. MODELO DE EQUAÇÕES SIMULTÂNEAS
  - 5.1 A natureza do modelo de equações Simultâneas
  - 5.2 O problema de identificação
  - 5.3 Estimação em dois e três estágios

---

ASSINATURA DO CHEFE DO DEPARTAMENTO