



UNIVERSIDADE CANDIDO MENDES

INSTITUTO DE ECONOMIA, GESTÃO E NEGÓCIOS

Programa de Pós-Graduação em Economia e Gestão Empresarial
MESTRADO EM ECONOMIA EMPRESARIAL

ECONOMETRIA

Programa e Bibliografia

Conteúdo	Bibliografia
PARTE I – INTRODUÇÃO A ECONOMETRIA	
1 – HISTÓRICO E ANTECEDENTES DA ECONOMETRIA	D.N. Gujarati. <i>Econometria Básica</i> . SP : Makron Books, 3ª edição, 2000. Capítulo 1 O . C. Matos, <i>Econometria Básica: Teoria e Aplicações</i> SP : Atlas, 1995. Capítulo 1.
2 – SÉRIES TEMPORAIS, DESSAZONALIZAÇÃO Tendência, Fator Sazonal e Termo Aleatório, Dessazonalização de séries (Método de Médias Móveis)	Hoffman, <i>Estatística para Economistas</i> . SP : Pioneira, 1998, 3ª edição. Capítulo 18. Morettin & Toloí. <i>Séries Temporais</i> . SP: Atual, 1987. Coleção Métodos Quantitativos.
3 – INTRODUÇÃO À ECONOMETRIA Conceito e Classificação de Modelos em Economia, Modelo Econométrico, Especificação de Modelos, Metodologia para desenvolvimento de modelos, Formas Funcionais Linearizáveis.	D.N. Gujarati. <i>Econometria Básica</i> . SP : Makron Books, 3ª edição, 2000. Capítulos 1 e 2. O . C. Matos, <i>Econometria Básica: Teoria e Aplicações</i> SP : Atlas, 1995. Capítulos 1 a 3
PARTE II – MODELO DE REGRESSÃO LINEAR	
4– REGRESSÃO LINEAR SIMPLES Estimção de Mínimos Quadrados, Intervalos de Confiança, Decomposição da Variação Amostral, Teste de hipóteses	D.N. Gujarati. <i>Econometria Básica</i> . SP : Makron Books, 3ª edição, 2000. Capítulos 3 a 6 O . C. Matos, <i>Econometria Básica: Teoria e Aplicações</i> SP : Atlas, 1995. Capítulos 4 e 5. J. Kmenta. <i>Elementos de Econometria</i> . SP : Atlas, 1988, volume 2.
5 – USO DE VARIÁVEIS ESPECIAIS: DUMMY Regressão com todas as variáveis dummies, Regressão com variáveis independentes quantitativa e qualitativa, Teste de Estabilidade Estrutural de Modelos, Uso de variável dummy na análise sazonal.	D.N. Gujarati. <i>Econometria Básica</i> . SP : Makron Books, 3ª edição, 2000. Capítulo 15. J. Kmenta. <i>Elementos de Econometria</i> . SP : Atlas, 1988, volume 2. Capítulo 11.
6 – REGRESSÃO LINEAR MÚLTIPLA O Caso de duas variáveis independentes, O caso de k variáveis independentes, Hipóteses do modelo, Estimador de Mínimos Quadrados em notação matricial, Matriz de Variância-Covariância, R^2 , teste F.	D.N. Gujarati. <i>Econometria Básica</i> . SP : Makron Books, 3ª edição, 2000. Capítulos 7 a 9. O . C. Matos, <i>Econometria Básica: Teoria e Aplicações</i> SP : Atlas, 1995. Capítulo 6.
PARTE III – VIOLAÇÃO DOS PRESSUPOSTOS DO MODELO	
7 – AUTOCORRELAÇÃO Descrição do Problema, Diagnóstico do Problema, Correção da Violação.	D.N. Gujarati. <i>Econometria Básica</i> . SP : Makron Books, 3ª edição, 2000. Capítulo 12. O . C. Matos, <i>Econometria Básica: Teoria e</i>

	<i>Aplicações SP : Atlas, 1995. Capítulo 9.</i>
8 – MULTICOLINEARIDADE Descrição do Problema, Diagnóstico do Problema, Correção da Violação.	D.N. Gujarati. <i>Econometria Básica</i> . SP : Makron Books, 3ª edição, 2000. Capítulo 10 O . C. Matos, <i>Econometria Básica: Teoria e Aplicações SP : Atlas, 1995. Capítulo 8</i>
9 – HETEROCEDASTICIDADE Descrição do Problema, Diagnóstico do Problema, Correção da Violação.	D.N. Gujarati. <i>Econometria Básica</i> . SP : Makron Books, 2000. Cap11 O . C. Matos, <i>Econometria Básica: Teoria e Aplicações SP : Atlas, 1995. Capítulo 10</i>

Dedicação à disciplina e frequência

Os mestrandos necessitam dedicar entre duas e três horas de estudos para cada hora de aula. A frequência às aulas é obrigatória; o número de faltas não pode superar 25% do total de aulas dadas. Em nenhuma hipótese haverá abono de faltas por parte do professor da disciplina.

Avaliação do desempenho dos alunos

A nota final da disciplina será calculada a partir de uma média aritmética ponderada das notas de duas provas parciais.

$$\text{Nota Final} = \frac{\text{Prova}_1 \cdot 4 + \text{Prova}_2 \cdot 6}{10}$$

A nota final será transformada em conceito, com o seguinte critério:

NOTA	CONCEITO
De 0,0 até 5,9	D (Insuficiente)
De 6,0 até 7,4	C (Regular)
De 7,5 até 8,9	B (Bom)
De 9,0 até 10,0	A (Excelente)
	I (Incompleto)

Na eventualidade de o aluno obter nota final **inferior a 6** (limite mínimo necessário para aprovação) será oferecida uma prova final, contemplando toda a matéria ministrada. A prova final terá **peso 6** e, somada às notas anteriores, deverão compor a nota final do aluno. Nesse caso:

$$\text{Nota Final} = \frac{\text{Prova}_1 \cdot 4 + \text{Prova}_2 \cdot 6 + \text{Prova Final} \cdot 10}{20}$$

Serão considerados aprovados os discentes que obtiverem média final igual ou superior a 6,0.

A realização das provas será obrigatoriamente feita no dia e horário de aula em que o aluno estiver regularmente matriculado, não sendo permitida a troca de dia/horário.