

FUNDAÇÃO UNIVERSIDADE FEDERAL DE RONDÔNIA – UNIR

NÚCLEO DE CIÊNCIAS SOCIAIS

DEPARTAMENTO DE ECONOMIA

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Código: ECO319 | Disciplina: ECONOMETRIA II | |
| CRÉDITOS | Carga Horária | Pré-Requisito(s) |
| 4 | 80 horas/aula |  |
| **Ementa** | | |
| MODELO DE REGRESSÃO LINEAR: ÁLGEBRA LINEAR; RELAXANDO AS PREMISSAS DO MODELO. CLÁSSICO DE REGRESSÃO LINEAR. MULTICOLINEARIEDADE. HETEROCEDASTICIDADE. AUTOCORRELAÇÃO. MODELOS DE SÉRIE TEMPORAL. MODELO AUTOREGRESSIVO INTEGRADO DE MÉDIA MOVÉIS – ARIMA. MODELOS VETOR AUTOREGRESSIVO - VAR E VETOR DE CORREÇÃO DE ERROS – VEC. | | |
| 2. Bibliografia | | |
| **Básica:**  BUENO, R. de Losso da S. **Econometria de séries temporais**. São Paulo: Cengage Learning, 2011.  GUJARATI, D. N. **Econometria básica.** 5. ed. - São Paulo: Pearson Makron Books, 2011.  WOOLDRIDGE, Jeffrey M. **Introdução à econometria -** uma abordagem moderna. 4. ed. – São Paulo: Cengage Learning, 2010.  **Complementar:**  HOFFMANN, R. **Estatística para economistas.** São Paulo: Pioneira, 2002.  HOFFMANN, R.; VIEIRA, S. **Análise de regressão.** Uma introdução à econometria. 3 ed. – São Paulo: Hucitec, 1998.  MORETTIN, Pedro A. **Econometria financeira** – um curso em séries temporais financeiras. 2. ed. - São Paulo: Edgard Blucher, 2011.  NEVES, Cesar das; ROSSI, José W. **Econometria e Séries Temporais** - com aplicações e dados da economia brasileira. São Paulo: Editora LTC, 2014.  PINDYCK, R.; RUBINFELD, D. **Econometria** **–** modelos e previsões. Rio de Janeiro: Campus, 2004. | | |
| **Avaliação:** | | |
| Forma | Peso | Data |
| Prova 1  Prova 2  Artigo Final | 30%  30%  40% | a definir.  a definir.  a definir. |

Conteúdo da disciplina: https://walberti.github.io/econometria/