



UNIVERSIDADE FEDERAL DE PERNAMBUCO
CENTRO DE CIÊNCIAS SOCIAIS APLICADAS
DEPARTAMENTO DE ECONOMIA
PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA

EC00924 – Econometria I

CH: 60 horas/aula

Créditos: 04

Docente: Francisco Cribari Neto

Objetivo

Introduzir o uso de modelos de regressão linear, modelos de regressão para respostas binárias, modelos de regressão beta. Estudar a violação das hipóteses básicas. Apresentar análise de séries temporais e previsões.

Programa

Introdução; Regressão simples; Regressão múltipla; Regressão com variáveis dummy; Multicolinearidade; Heteroscedasticidade; Autocorrelação; Modelos de regressão para respostas binárias; Regressão beta; Algoritmos de allisamento exponencial; Modelos AR, MA, ARMA, ARMAX, ARIMA e SARIMA; Testes de raiz unitária; Previsão de séries temporais; Tópicos especiais.

Método de Avaliação

Duas provas, dois tabalhos.

Referências Bibliográficas

Diversos artigos científicos.