|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA |  | PROGRAMA ANALÍTICO DE DISCIPLINA |  | No  FOLHA: RUBRICA: |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| IDENTIFICAÇÃO | | | | | | |
| DISCIPLINA:Métodos Econométricos | | | | | CÓDIGO: ECO655 | |
| DEPARTAMENTO: Economia | | | | | SIGLA DA  UNIDADE: CCH | |
| DURAÇÃO EM SEMANAS | CARGA HORÁRIA SEMANAL | | | | | CARGA HORÁRIA TOTAL |
| 15 | TEÓRICAS:4 | PRÁTICAS: | | TOTAL:4 | | 60 |
| NÚMERO DE CRÉDITOS:4 | | | PERÍODO: II | | | |
| PRÉ-REQUISITOS | | | PRÉ OU CO-REQUISITOS | | | |
|  | | |  | | | |
|  | | |  | | | |
|  | | |  | | | |

|  |
| --- |
| EMENTA |
| Modelos de Regressão Múltipla e de Equações Simultâneas; Modelos de escolha qualitativa; Introdução à séries de tempo; Método dos Momentos Generalizados; Análise de dados em painel. |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| CURSOS PARA OS QUAIS É MINISTRADA(SOMENTE PARA CURSOS DE GRADUAÇÃO) | | | |
| 1. | ( ) | 7. | ( ) |
| 2. | ( ) | 8. | ( ) |
| 3. | ( ) | 9. | ( ) |
| 4. | ( ) | 10. | ( ) |
| 5. | ( ) | 11. | ( ) |
| 6. | ( ) | 12. | ( ) |
| (OB)= OBRIGATÓRIA (OP)= OPTATIVA | | | |

|  |
| --- |
| No DA ATA DA REUNIÃO: DATA DE APROVAÇÃO: |
| \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |
| CHEFE DO DEPARTAMENTO |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| ALTERAÇÃO | APROVADA  PELO | CTP CTG |  | APROVAÇÃO | DA COORDENAÇÃO DE ENSINO, PESQUISA E EXTENSÃO - CEPE |
| NO DA ATA DA REUNIÃO DATA DE APROVAÇÃO: | | |  | NO DA ATA DA REUNIÃO DATA DE APROVAÇÃO | |
| \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_\_\_ | | |  | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_\_ | |
| \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | | |  | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | |
| PRESIDENTE DO CONSELHO | | |  | SECRETÁRIO DE ÓRGÃOS COLEGIADOS | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA |  | PROGRAMA ANALÍTICO DE DISCIPLINA (continuação) |  | No  FOLHA: RUBRICA: |

|  |  |
| --- | --- |
| DISCIPLINA:Métodos Econométricos | CÓDIGO: ECO 655 |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| UNIDADES E ASSUNTOS | AULAS TEÓRICAS | AULAS  PRÁTICAS | NO DE  HORAS-AULA |
| 1. **Modelos de Regressão Múltipla e de Equações Simultâneas**    1. Mínimos Quadrados Ordinários (MQO)    2. Inferência    3. Violação de Pressupostos: Multicolinearidade; Heteroscedasticidade; Autocorrelação.    4. MínimosQuadradosPonderados (MQP)    5. Equações Simultâneas: Problema de simultaneidade;    6. Mínimos Quadrados em Dois Estágios (MQ2E).    7. Teste de Endogeneidade 2. **Modelos de EscolhaQualitativa**    1. Modelos de EscolhaBinária    2. Modelos de MúltiplaEscolha    3. Modelos de RegressãoCensurada 3. **Introdução a Séries de Tempo**    1. Natureza dos Dados das Séries Temporais    2. SériesTemporaisEstacionárias    3. Tendência e Sazonalidade    4. Testes de RaizUnitária    5. RegressãoEspúria    6. Cointegração 4. **Método dos Momentos Generalizados (GMM)**    1. O estimador GMM    2. O Problema de momentos e o MQO    3. Variáveis Instrumentais e o Problema de Momentos    4. GMM e a condição de ortogonalidade    5. Distribuição do estimador GMM 5. **Análise de Dados emPainel**    1. O problema do viés de variáveis omitidas    2. Pooled OLS    3. Modelo de EfeitosFixos    4. Modelo de EfeitosAleatórios    5. Diferenciação dos Metódos    6. Introdução a Dados em Painel Dinâmico | | | 10  9  14  13  14 |

|  |  |
| --- | --- |
|  | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_  CHEFE DO DEPARTAMENTO |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA |  | REFERÊNCIAS  BIBLIOGRÁFICAS |  | No  FOLHA: RUBRICA: |

|  |  |
| --- | --- |
| DISCIPLINA:Métodos Econométricos | CÓDIGO: ECO 655 |

|  |
| --- |
| CAMERON, A. C.; TRIVEDI, P. K. **Microeconometrics: Methods and Applications.** Cambridge University Press, 2005.  ENDERS, W. **Applied econometric time series**. New York: Jonh Wiley, 2009. 544p.  FAVA, V.L. Teste de Raízes Unitárias e Co-integração. In: VASCONCELOS, M.A.S. e ALVES, D. (Org)**. Manual de Econometria**. São Paulo:USP, 2000. p. 245-252.  GREENE, W. H. **Econometric Analysis**. 5 ed. New York: Pearson, 2012. 1198p.  GUJARATI, D.N. **Econometria Básica**. 4 ed. Rio de Janeiro: Elsevier. 2006. 819p.  JUDGE, G.G.; GRIFFTHS, W.E.; HILL, R.C.; LÜTKPOHL, H.; LEE, T.C. **The Theory and Practice of Econometrics**. 2. ed. New York: Wiley, 1988. 1064p.  Johnston, J. e DiNardo, J.**Econometric methods.** New York: Editora McGraw-Hill, 1997. 531 p.  MARQUES, L.D. **Modelos Dinâmicos com Dados em Painel: revisão de literatura.** Centro de Estudos Macroeconômicos e Previsão, Faculdade de Economia do Porto, 2000. 84p. (Texto para discussão, 100).  Pindyck, R.S.; Rubinfeld, D. L.**Econometria: Modelos e Previsões**. Rio de Janeiro: Editora Campus, 2004. 726p.  WOOLDRIDGE, J.M. **Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data.** Cambridge: MIT Press. 2010. 1096p. |

|  |
| --- |
| \_\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_\_  \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_  CHEFE DO DEPARTAMENTO |