|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | 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 | AULASTEÓRICAS | 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
 | 109141314 |

|  |  |
| --- | --- |
|  | \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_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 |