Universidade Federal de Goiás
Faculdade de Administração, Economia e Contabilidade – FACE
Programa de Pós Graduação em Economia – PPE

Disciplina: Econometria I Carga Horária: 64 ha Créditos: 4
Professora: Waleska de Fátima Monteiro
Horário: segunda-feira (14:00 às 17:40) terça-feira (08:20 às 12:00)
e-mail: wfmonteiro05@gmail.com Sala FACE – (a definir)

EMENTA:
Apresentação de conceitos e instrumentos necessários para a compreensão da econometria, ou seja, inferência estatística e formas clássicas e assimptótica do modelo linear de regressão. Análise das hipóteses básicas do modelo de regressão, seus possíveis problemas e soluções. Apresentação de métodos alternativos de análises empíricas. Aplicações econométricas práticas.

Não há livro texto requerido. Sugestões de leitura são dadas no programa abaixo.

OBJETIVO:
O objetivo da disciplina é nivelar a turma quanto ao instrumental básico de econometria, bem como aplicação de alguns modelos em programas estatísticos (Stata) quando possível.

PROGRAMA:
Parte I
1. Modelo de regressão linear clássico.
2. Diagnóstico e análise dos pressupostos do modelo clássico.
3. Multicolinearidade, Heterocedasticidade e Autocorrelação.

Leitura mínima recomendada: [GR], caps. 1 a 4.

Parte II
4. Introdução a modelos lineares generalizados.
5. Método de estimação – Método de Máxima Verossimilhança (EMV).
6. Método de estimação – Método Generalizado de Momentos (GMM).
7. Introdução à análise de séries temporais

Leitura mínima recomendada: [HA] caps. 1 a 3 e 7, [GR] caps. 5 a 12.

Parte III
8. Introdução a modelos de regressão com dados em painel (caso haja tempo)
9. Tópicos Especiais Avançados (caso haja tempo)

Leitura mínima recomendada: [GR] caps. 13, 19 a 22;

AVALIAÇÃO:
Duas provas (sem consulta) e um artigo, todos com o mesmo peso. A nota será a média aritmética destas três notas. O artigo será sobre um tema de interesse do aluno ou alguma pesquisa que seja desenvolvida com o orientador (a). No entanto, o artigo deve conter alguma

ferramenta econométrica. O modelo econométrico escolhido deverá ser "aberto" deduzindo e/ou comprovando as hipóteses do modelo.
Data de entrega do artigo: No dia da segunda prova
O artigo pode ser feito em dupla

REFERÊNCIAS:
Principais

[GR] Greene, W (2000) Econometric Analysis, 4a ed., Prentice Hall.
[HA] Hayashi, F (2000) Econometrics, Princeton.
[WO] Wooldridge, JM (2002) Econometric Analysis of Cross-Section and Panel Data, MIT Press.

Complementares

[CB] Casella, G; Berger, RL (2001) Statistical Inference, 2nd ed., Duxbury.
[GU] Gujarati, D.N. (1995). Basic Econometrics, 3rd ed. New York: McGraw-Hill.
[HD] Hamilton, J.D. (1994). Time Series Analysis. Princeton: Princeton University Press.
[HO] HOFFMANN, R. & VIEIRA, (1998) S. Análise de Regressão. Uma Introdução à Econometria. 3 ed., Hucitec, São Paulo.
[JO] JOHNSTON, J. (1976) Métodos Econométricos. Atlas, 1976, São Paulo.
[JD] JOHNSTON, J. & DINARDO, J. (1997) Econometric Methods. 4ª ed., McGraw-Hill Companies, New York.
[MO] Morettin, P.A. (2008). Econometria Financeira: um curso em séries temporais financeiras. São Paulo: Editora Blucher.
[MT] Morettin, P.A., Toloi, C.M.C. (2006). Análise de Séries Temporais. São Paulo: Edgard Blücher.

Artigos também poderão ser indicados ao longo do curso.

_____.
Waleska de Fátima Monteiro