

Programa Analítico de Disciplina

ECO 655 - Métodos Econométricos

Departamento de Economia - Centro de Ciências Humanas, Letras e Artes

Catálogo: 2022

Número de créditos: 4
Carga horária semestral: 60h
Carga horária semanal teórica: 3h
Carga horária semanal prática: 1h
Semestres: II

Ementa

Microdados
Modelos de Regressão Múltipla e de Equações Simultâneas
Modelos de Escolha Qualitativa
Regressão Quantílica
Análise de Dados em Painel
Análise de Modelos Multi-nível

Conteúdo

Unidade	T	P	To
1. Microdados 1. Extração de Microdados 2. Análises econométricas com microdados	2h	3h	5h
2. Modelos de Regressão Múltipla e de Equações Simultâneas 1. Mínimos Quadrados Ordinários (MQO) 2. Inferência 3. Violação de Pressupostos: Multicolinearidade; Heteroscedasticidade; Autocorrelação. 4. Mínimos Quadrados Ponderados (MQP) 5. Equações Simultâneas: Problema de simultaneidade; 6. Mínimos Quadrados em Dois Estágios (MQ2E). 7. Teste de Endogeneidade	11h	4h	15h
3. Modelos de Escolha Qualitativa 1. Modelos de Escolha Binária 2. Modelos de Múltipla Escolha 3. Modelos de Regressão Censurada	8h	2h	10h

A autenticidade deste documento pode ser conferida no site <https://siadoc.ufv.br/validar-documento> com o código: CPKV.7WR4.N31S

<p>4. Regressão Quantílica</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Definição de Quantil 2. Definição de Regressão Quantílica 3. Inferência 4. Qualidade do Ajuste em Regressões Quantílicas 	8h	2h	10h
<p>5. Análise de Dados em Painel</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. O problema do viés de variáveis omitidas 2. Pooled OLS 3. Modelo de Efeitos Fixos 4. Modelo de Efeitos Aleatórios 5. Pseudo-Painel: <ol style="list-style-type: none"> 1. Criação de Cohorts 2. Modelo de Efeitos fixos 	8h	2h	10h
<p>6. Análise de Modelos Multi-nível</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Porque utilizar modelos Multi-Nível? 2. Estimação de modelos com dois níveis 3. Modelos com mais de dois níveis 4. Análise de ajustamento dos modelos 	8h	2h	10h
Total	45h	15h	60h

Teórica (T); Prática (P); Total (To);

ECO 655 - Métodos Econométricos

Bibliografias básicas

Descrição	Exemplares
CAMERON, A. C.; TRIVEDI, P. K. Microeconometrics: Methods and Applications. Cambridge University Press, 2005.	1
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.	1
FÁVERO, L. P. Análise de Dados: modelos de regressão com Excel, Stata e SPSS. Rio de Janeiro: Elsevier. 2015. 504p.	1
GREENE, W. H. Econometric Analysis. 5 ed. New York: Pearson, 2012. 1198p.	1
GUJARATI, D.N. Econometria Básica. 4 ed. Rio de Janeiro: Elsevier. 2006. 819p.	12
JUDGE, G.G.; GRIFFITHS, W.E.; HILL, R.C.; LÜTKPOHL, H.; LEE, T.C. The Theory and Practice of Econometrics. 2. ed. New York: Wiley, 1988. 1064p.	1
JOHNSTON, J. E DINARDO, J. Econometric methods. New York: Editora McGraw-Hill, 1997. 531 p.	1
KOENKER, Roger. Quantile Regression. New York: Cambridge University Press. 2005.	1
PINDYCK, R.S.; RUBINFELD, D. L. Econometria: Modelos e Previsões. Rio de Janeiro: Editora Campus, 2004. 726p.	6
WOOLDRIDGE, J.M. Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data. Cambridge: MIT Press. 2010. 1096p.	1

Bibliografias complementares

Não definidas