

# Programa Analítico de Disciplina

## ECO 655 - Métodos Econométricos

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

Catálogo: 2024

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
<b>1. Microdados</b> 1. Extração de Microdados  2. Análises econométricas com microdados	2h	3h	5h
<b>2. Modelos de Regressão Múltipla e de Equações Simultâneas</b> 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
<b>3. Modelos de Escolha Qualitativa</b> 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: GR29.BARW.AHXQ

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

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*

### Pontos de controle

Campo	Anterior	Atual
Conteúdo	Há alterações no conteúdo da disciplina	

# Syllabus

## ECO 655 - Econometric Methods

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

Catalog: 2024

Number of credits: 4  
Total hours: 60h  
Weekly workload - Theoretical: 3h  
Weekly workload - Practical: 1h

Period: II

### Content

Microdata  
Multiple Regression and Simultaneous Equation Models  
Probability Models  
Quantile Regression  
Panel Data Analysis  
Multilevel Model Analysis

### Course program

Unit	T	P	To
<b>1. Microdata</b> 1.1. Microdata Extraction 2. Econometric analyzes with microdata	2h	3h	5h
<b>2. Multiple Regression and Simultaneous Equation Models</b> 1. Ordinary Least Squares (OLS); 2. Inference; 3. Violation of Assumptions: Multicollinearity; Heteroscedasticity; Autocorrelation; 4. Weighted Least Squares (MQP); 5. Simultaneous Equations: Simultaneity problem; 6. Two-Stage Least Squares (MQ2E); 7. Endogeneity Test	11h	4h	15h
<b>3. Probability Models</b> 1. Binary Outcome Models; 2. Multinomial Models; 3. Tobit and selection models;	8h	2h	10h

A autenticidade deste documento pode ser conferida no site <https://siadoc.ufv.br/validar-documento> com o código: GR29.BARW.AHXQ

<p><b>4. Quantile Regression</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Definition of quantiles;</li> <li>2. Definition of Quantile Regression;</li> <li>3. Inference;</li> <li>4. Quality of fit in Quantile Regressions</li> </ol>	8h	2h	10h
<p><b>5. Panel Data Analysis</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. The problem of omitted variable bias</li> <li>2. Pooled OLS</li> <li>3. Fixed Effects Model</li> <li>4. Random Effects Model</li> <li>5. Pseudo-Panel:               <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Creation of Cohorts</li> <li>2. Fixed Effects Model</li> </ol> </li> </ol>	8h	2h	10h
<p><b>6. Multilevel Model Analysis</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Why use Multilevel models?</li> <li>2. Estimation of models with two levels;</li> <li>3. Models with more than two levels;</li> <li>4. Model fit analysis.</li> </ol>	8h	2h	10h
<b>Total</b>	<b>45h</b>	<b>15h</b>	<b>60h</b>

Theoretical (T); Practical (P); Total (To);

## ECO 655 - Econometric Methods

### Fundamental references

Description	Copies
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

### Complementary references

*Not defined*

### Pontos de controle

Campo	Anterior	Atual
Conteúdo	Há alterações no conteúdo da disciplina	