

Programa Analítico de Disciplina

ECO 457 - Econometria III

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

Catálogo: 2025

Número de créditos: 4

Carga horária semestral: 60h

Carga horária semanal teórica: 2h

Carga horária semanal prática: 2h

Carga horária de extensão: 0h

Semestres: I

Objetivos

A disciplina ECO 457 – Econometria III tem o objetivo de capacitar o estudante para trabalhar com grandes amostras, voltando-se para estimadores assintóticos, valendo-se de dados cross-section e de painel. Ao final do curso o discente deverá ser capaz de aplicar os métodos para análise e solução de problemas microeconômicos, políticas públicas, entre outros.

Ementa

Introdução a Microdados. Teoria de Grandes Amostras. Inferência em Grandes Amostras. Modelos de Escolha Qualitativa. Modelos de Dados em Painel. Pesquisa em Economia.

Pré e correquisitos

ECO 450

Oferecimentos obrigatórios

Curso

Período

Ciências Econômicas

7

Oferecimentos optativos

Não definidos

ECO 457 - Econometria III

Conteúdo					
Unidade	T	P	ED	Pj	To
1. Introdução a Microdados 1. Teórico 1. Conceitos de Amostra Complexa 2. Prático 1. Extração de microdados da PNAD 2. Estratificação da amostra 3. Análise descritiva de dados 4. Análise de regressão 3. Aplicações na pesquisa econômica.	2h	6h	0h	0h	8h
2. Teoria de Grandes Amostras 1. Estimador de Máxima Verossimilhança (MV) 2. 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 3. Aplicações na pesquisa econômica.	4h	2h	0h	0h	6h
3. Inferência em Grandes Amostras 1. O método de Monte Carlo 2. O método de Bootstrap 3. Aplicações na pesquisa econômica.	4h	2h	0h	0h	6h
4. Modelos de Escolha Qualitativa 1. Teórico 1. Modelos de Probabilidade Linear (MPL) 2. Modelo Logit 3. Modelo Probit 4. Modelo Tobit 2. Prático 1. Estimação e análise de Modelos não lineares de probabilidades utilizando dados da PNAD 3. Aplicações na pesquisa econômica.	10h	10h	0h	0h	20h
5. Modelos de Dados em Panel 1. Teórico 1. Pooled 2. Modelo de Efeitos Fixos 3. Modelo de Efeitos Aleatórios 2. Prático 1. Estimação e interpretação de Modelos de Dados em Painel 3. Aplicações na pesquisa econômica.	10h	10h	0h	0h	20h
Total	30h	30h	0h	0h	60h

Teórica (T); Prática (P); Estudo Dirigido (ED); Projeto (Pj); Total (To);

Planejamento pedagógico	
Carga horária	Itens
Teórica	Apresentação de conteúdo oral e escrito em quadro convencional; Apresentação de conteúdo oral e escrito com o apoio de equipamento (projetor, quadro-digital, TV, outros); e Apresentação de conteúdo pelos estudantes, mediado pelo professor
Prática	Prática demonstrativa realizada pelo professor ou monitor, Prática executada por todos os estudantes e Prática investigativa executada por todos os estudantes
Estudo Dirigido	<i>Não definidos</i>
Projeto	<i>Não definidos</i>
Recursos auxiliares	<i>Não definidos</i>

ECO 457 - Econometria III

Bibliografias básicas

Descrição	Exemplares
MADDALA, G. S. Introdução à Econometria. 3.ed. Rio de Janeiro: LTC, 2003.	1
PINDYCK, R. S.; RUBINFELD, D. L. Econometria: modelos e previsões. Tradução da 4.ed. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004.	2
WOOLDRIDGE J. M. Introdução à econometria. São Paulo: Pioneira Thomson Learning, 2006.	0
PESSOA, D.G.C; SILVA, P.L. do N. Análise de dados amostrais Complexos. IBGE. 1998. (disponível http://www.ie.ufrj.br/download/livro.pdf)	0

Bibliografias complementares

Descrição	Exemplares
VASCONCELLOS, M. A. S.; ALVES, D. (Editores). Manual de econometria. São Paulo: Atlas, 2000.	0
GUJARATI, D.N. Econometria básica. Rio de Janeiro: Elsevier, 2006. 812 p.	14
Textos selecionados	0