

Programa Analítico de Disciplina

ECO 655 - Métodos Econométricos

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

Catálogo: 2025

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: 5OUN.BRO3.NUDJ

4. Regressão Quantílica 1. Definição de Quantil 2. Definição de Regressão Quantílica 3. Inferência 4. Qualidade do Ajuste em Regressões Quantílicas	8h	2h	10h
5. Análise de Dados em Panel 1. O problema do viés de variáveis omitidas 2. Pooled OLS 3. Modelo de Efeitos Fixos 4. Modelo de Efeitos Aleatórios 5. Pseudo-Painel: 1. Criação de Cohorts 2. Modelo de Efeitos fixos	8h	2h	10h
6. Análise de Modelos Multi-nível 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

Syllabus

ECO 655 - Econometric Methods

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

Catalog: 2025

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
1. Microdata 1.1. Microdata Extraction 2. Econometric analyzes with microdata	2h	3h	5h
2. Multiple Regression and Simultaneous Equation Models 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
3. Probability Models 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: 5OUN.BRO3.NUDJ

4. Quantile Regression 1. Definition of quantiles; 2. Definition of Quantile Regression; 3. Inference; 4. Quality of fit in Quantile Regressions	8h	2h	10h
5. Panel Data Analysis 1. The problem of omitted variable bias 2. Pooled OLS 3. Fixed Effects Model 4. Random Effects Model 5. Pseudo-Panel: 1. Creation of Cohorts 2. Fixed Effects Model	8h	2h	10h
6. Multilevel Model Analysis 1. Why use Multilevel models? 2. Estimation of models with two levels; 3. Models with more than two levels; 4. Model fit analysis.	8h	2h	10h
Total	45h	15h	60h

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