



## PROGRAMA DE ENSINO

<b>Curso:</b> Programa de Pós-Graduação em Economia	Ano letivo: 2018	Semestre: 2
<b>Disciplina:</b> Econometria	Carga horária: 60	Código: ECO103
<b>Responsáveis:</b> Andreza Aparecida Palma e Manoel Vitor de Souza Veloso		
<b>Ementa</b>		
Métodos de Estimação. Inferência Estatística. Regressão Linear. Autocorrelação e heterocedasticidade. Estimação com variáveis instrumentais. Modelos ARIMA (identificação, estimação e previsão). Cointegração (estacionariedade, tendência e passeio aleatório, raízes unitárias). Vetores auto-regressivos.		
<b>Objetivos</b>		
O objetivo da disciplina de Econometria é revisar de forma mais aprofundada alguns tópicos geralmente vistos na graduação além de introduzir elementos mais avançados. Espera-se que ao final da disciplina os alunos estejam aptos a realizar trabalhos empíricos de econometria e previsão de séries de tempo. Nesse sentido, os alunos serão estimulados a aplicar os métodos estudados a problemas concretos de economia/finanças		
<b>Conteúdo Programático</b>		
Métodos de Estimação: mínimos quadrados ordinários		
Inferência Estatística Clássica (frequentista)		
Regressão Linear		
Mínimos Quadrados Ordinários: autocorrelação e heterocedasticidade		
Endogeneidade e estimação com Variáveis Instrumentais		
Modelos ARIMA: estacionariedade, identificação, estimação, previsão; modelos sazonais.		
Co-integração , modelos VAR (vetores autorregressivos) e VEC (vetor de correção de erros)		



### Bibliografia

- BUENO, R.de L da S (2008), Econometria de Séries Temporais, CENGAGE, São Paulo
- CASELA, G. and BERGER, R (2002). Statistical Inference. Duxbury.
- DAVIDSON, R. e MACKINNON, J. G. (2004), Econometric Theory and Methods, Oxford University Press, Oxford.
- ENDERS, W. (2010), Applied Econometric Time Series, third edition, John Wiley & Sons, Nova York.
- GHYSELS, E. ; MASSIMILIANO, M. (2018) Applied Economic Forecasting using Time Series Methods, Oxford University Press, Oxford.
- GOLDBERG , A. (1991) A course in econometrics. Camb. Mass.: Harvard University Press.
- GREENE, W. H. (1999), Econometric Analysis, Prentice-Hall, New Jersey
- HAMILTON , J. (1994) Time series analysis. Princeton: Princeton University Press.
- RUUD, P. A. (2000) An Introduction to Classical Econometric Theory, Oxford University Press, Oxford.

**\*\* outras referências podem ser indicadas ao longo do curso**

### Critérios de Avaliação

Atividades	Valor
Parte 1 – Manoel (50%)	
Estudo de caso – Ajuste completo de Regressão Linear e diagnósticos	100%
Parte 2 – Andreza (50%)	
Trabalho empírico (séries temporais)	60%
Listas de Exercícios (teóricas e práticas)	30%
Participação na aula	10%

*Aprovado pelo Colegiado do PPGEconomia em sua 11ª reunião, realizada em 05/09/2018.*