



PROGRAMA DE ENSINO

Curso: Programa de Pós-Graduação em Economia	Ano letivo: 2017	Semestre: 2
Disciplina: Econometria	Carga horária: 60	Código:
Responsáveis: Andreza Aparecida Palma		
Ementa		
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.		
Objetivos		
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		
Conteúdo Programático		
Métodos de Estimação: máxima verossimilhança, mínimos quadrados ordinários, método generalizado dos momentos.		
Inferência Estatística Clássica (frequentista)		
Regressão Linear		
Mínimos Quadrados Generalizados: 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.

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.

Critérios de Avaliação

Atividades	Valor
Trabalho empírico	60%
Prova	30%
Listas de exercícios	10%

Aprovado pelo Colegiado do PPGEconomia em sua reunião, realizada no dia 28/06/2017.