

Nome do Componente Curricular: Econometria	
Pré-requisitos: Probabilidade e Estatística; Cálculo em Várias Variáveis	
Carga Horária Total: 72h	
Carga Horária Prática: 22h	Carga Horária Teórica: 50h
<p>Objetivos</p> <p>Gerais:</p> <p>O objetivo desse curso é oferecer aos alunos de graduação uma abordagem teórica e prática dos principais métodos econométricos modernos, a fim de inicializá-los para a realização de pesquisas de natureza econômica. Conhecimentos básicos de Matemática (especialmente cálculo diferencial e álgebra matricial) e Estatística (especialmente teoria probabilística) são desejáveis para um aproveitamento efetivo do curso. Faremos uso do Software GRETl para a solução dos exercícios e atividades em classe.</p> <p>Específicos:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Introduzir as principais técnicas econométricas para realização de pesquisas. • Apresentar como realizar pesquisas econométricas utilizando computação. • Demonstrar matematicamente e estatisticamente de maneira simples as principais ideias da econometria. 	
<p>Ementas:</p> <p>1. Modelos Lineares; 2. Teoria da Distribuição Assimptótica; 3. Modelos de Regressão Genérica; 4. Problema com Dados; 5. Noções de Séries de Tempo.</p>	
<p>Conteúdo Programático:</p> <p>1. Modelos Lineares: regressão múltipla, propriedades estatísticas do estimador de mínimos quadrados, inferência estatística (testes de hipóteses, restrições lineares), testes de significância da regressão e análise de variância, testes de previsão, testes de mudança estrutural e estabilidade;</p> <p>2. Teoria da distribuição assimptótica: estimadores e limites de probabilidade, convergência para variável randômica, teoremas do limite central, propriedades de estimadores de máxima verossimilhança, vies e ineficiência do estimador de mínimos quadrados (OLS);</p> <p>3. Modelos de regressão genérica: erros não esféricos (heterocedasticidade e autocorrelação), GMM (Método dos Momentos), testes de restrições: LR (Razão de Verossimilhança), LM (Multiplicador de Lagrange) e Wald; modelo SURE (Regressões Aparentemente não Correlacionadas), GLS (Mínimos Quadrados Generalizados) FGLS (Mínimos Quadrados Generalizados Estimados);</p> <p>4. Problemas com dados: multicolinearidade, variáveis proxy, método das variáveis instrumentais e mínimos quadrados de dois estágios;</p> <p>5. Noções de séries temporais.</p>	
<p>Metodologia de Ensino Utilizada:</p> <p>Aulas expositivas com atividades em classe e listas de exercícios, atividades no Moodle, exercícios no laboratório de Informática.</p>	
<p>Recursos Instrucionais Necessários:</p> <p>Multimídia, lousa, laboratório de informática e acesso ao MOODLE como ferramenta EAD.</p>	
<p>CrITÉrios de Avaliação:</p> <p>O sistema de avaliação será definido pelo docente responsável pela unidade curricular no início das atividades letivas devendo ser aprovado pela Comissão de Curso e divulgado aos alunos. O sistema adotado deve contemplar o processo de ensino e aprendizagem estabelecido neste Projeto Pedagógico, com o objetivo de favorecer o progresso do aluno ao longo do semestre. A promoção do aluno na unidade curricular obedecerá aos critérios estabelecidos pela Pró-Reitoria de Graduação, tal</p>	

como discutido no Projeto Pedagógico do Curso.

Bibliografia

Básica:

1. Wooldridge, J.M. Introdução à Econometria, 4. Ed. Cengage, 2011.
2. Brooks, C. Introductory Econometrics for Finance, 2. Ed. Cambridge, 2008.
3. Gujarati, D. Econometria Básica, 4.ed, Campus, 2006.

Complementar:

1. Casella, G.; Berger, R.L. Inferência Estatística, 2. Ed. Cengage, 2011.
2. Greene, William H. Econometric analysis. 7th ed. Upper Saddle River, N.J: Pearson/Prentice Hall, 2012.
3. Kennedy, P. Manual de Econometria, Campus, 2009.
4. Angrist, J.D.; Pischke, J. Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion, Princeton University Press, 2008.
5. Ruud, Paul A. An introduction to classical econometric theory. New York: Oxford University Press, 2000.