



UNIVERSIDADE FEDERAL DO RIO GRANDE - FURG
INSTITUTO DE CIÊNCIAS ECONÔMICAS, ADMINISTRATIVAS E
CONTÁBEIS/ICEAC
MESTRADO EM ECONOMIA APLICADA/PPGE



Disciplina: Econometria

Prof. Dr. Cristiano Aguiar de Oliveira

Carga Horária: 45 horas/aulas

Obrigatória: Sim

Crédito: 3 créditos

EMENTA:

O Modelo Linear Geral: Estimação de Mínimos Quadrados, Estimação de Máxima Verossimilhança, Multicolinearidade e Variáveis Binárias. O Modelo Linear Generalizado: Heterocedasticidade, Autocorrelação, Método dos Momentos Generalizados (GMM). Séries Temporais: Processos estocásticos, Modelos ARIMA, Raízes Unitárias, Regressão Espúria e Cointegração no sentido de Engle-Granger VAR, Cointegração no sentido de Johansen e Vetor de Correção de Erros.

OBJETIVO:

O objetivo dessa disciplina é familiarizar o aluno de pós-graduação com o instrumental de estatística aplicada à economia, apresentando algumas das principais metodologias utilizadas na construção de trabalhos científicos e dissertações.

SISTEMA DE AVALIAÇÃO:

A avaliação será realizada com base em listas de exercícios e a realização de duas provas.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO:

UNIDADE 1 – Modelos Lineares

- 1.1 Hipóteses clássicas;
- 1.2 Estimador de Mínimo Quadrado;
- 1.3 Estimador de Máxima Verossimilhança;
- 1.4 Teorema de Gauss-Markov;
- 1.5 Modelo com Erro Normal;

UNIDADE 2 – Mínimos Quadrados Generalizados

- 2.1 Heterocedasticidade;
- 2.2 Autocorrelação;
- 2.3 Multicolinearidade;
- 2.4 Modelo de Regressão aparentemente não relacionado;

UNIDADE 3 – Método dos Momentos Generalizados

- 3.1 Hipóteses de definição;
- 3.2 Estimadores;
- 3.3 Restrições do método;

UNIDADE 4 – Modelo de equações simultâneas

- 4.1 Sistema de equações;
- 4.2 Endogeneidade e Causalidade;
- 4.3 Identificação;
- 4.4 MQ2Estágios e MQ3Estágios;

UNIDADE 5 – Modelos com Variáveis Binárias

- 5.1 Definição de variáveis aleatórias discretas;
- 5.2 Estimação de variáveis discretas;
- 5.3 Modelos Logit e Probit;

UNIDADE 6 – Modelos Univariados e Multivariados

- 6.1 Modelos AR;
- 6.2 Modelos MA;
- 6.3 Modelos ARMA;
- 6.4 Estacionariedade;
- 6.5 Modelos ARIMA;
- 6.6 Modelos VAR;
- 6.6 Co-Integração;
- 6.7 Modelos VEC;

BIBLIOGRAFIA

- BUENO, R. L. S. *Econometria de Séries Temporais*. 2a Ed. São Paulo: Cengage learning, 2012
- CUTHBERTSON, K.; HALL, S. G.; TAYLOR, M. P. *Applied Econometric Techniques*, Harvester Wheatsheaf, Londres, 1992
- DAVIDSON, R.; MACKINNON, J. G. *Estimation and Inference in Econometrics*, Oxford University Press, Oxford, 1993
- DAVIDSON, R.; MACKINNON, J. G. *Econometric Theory and Method*. Oxford U. Press, 2004
- ENDERS, W. *Applied Econometric Time Series*, John Wiley & Sons, Nova York, 1995.
- GREENE, W. H. *Econometric Analysis*, 7rd edition, Prentice-Hall, New Jersey, 2008.
- GUJARATI, D. *Basic Econometric*, McGraw-Hill, New York, 2003.
- HAYASHI, F. *Econometrics*. Princeton University Press, 2000.
- JUDGE, G. G. et ali. *Introduction to the Theory and Practice of Econometrics*, 2nd edition, John Wiley and Sons, Nova York, 1988.
- HAMILTON, J. D. *Time Series Analysis*, Princeton University Press, Princeton, 1994.
- HARRIS, H. *Using Cointegration Analysis in Econometric Modelling*, Prentice Hall, Londres, 1995.
- HENDRY, D. F. *Dynamic Econometrics*, Oxford University Press, Oxford, 1995.
- NELSON, C. *Applied Time Series Analysis*, Holden-Day, San Francisco, 1973.
- PATTERSON, K. *An Introduction to Applied Econometrics*. Macmillan Press, 2001.
- RAO, B. B. *Cointegration for Applied Economist*, Macmillan, Londres, 1994.
- RUUD, P. *Classical Econometric Theory*. Oxford University Press, 2001.
- WOOLDRIDGE, J. *The Econometrics of Cross Section and Panel Data*. MIT Press, 2000.