

Programa Analítico de Disciplina

ERU 626 - ECONOMETRIA

Departamento de Economia Rural - Centro de Ciências Agrárias

Catálogo: 2023

Número de créditos: 4

Carga horária semestral: 60h

Carga horária semanal teórica: 4h

Carga horária semanal prática: 0h

Carga horária de extensão: 0h

Semestres: I

Ementa

O MÉTODO ECONOMETRICO
MODELO DE REGRESSÃO LINEAR
PROBLEMAS ECONOMETRICOS NO MODELO LINEAR
OUTROS MÉTODOS DE ESTIMAÇÃO
USO DE VARIÁVEIS BINÁRIAS NO MODELO DE REGRESSÃO
MODELOS MULTIEQUACIONAIS
ANÁLISE DE SÉRIES TEMPORAIS
ANÁLISE DE DADOS EM PAINEL

Conteúdo

Unidade	T	P	To
1. O MÉTODO ECONOMETRICO 1. Metodologia da Econometria 2. Tipos e Características dos Dados Econômicos	4h	0h	4h
2. MODELO DE REGRESSÃO LINEAR 1. Estrutura Matricial do Modelo 2. Pressuposições 3. Estimação dos Parâmetros do Modelo 4. Avaliação do Modelo Estimado 5. Testes de Hipóteses sobre os Parâmetros do Modelo	12h	0h	12h
3. PROBLEMAS ECONOMETRICOS NO MODELO LINEAR 1. Multicolinearidade 2. Heterocedasticidade 3. Autocorrelação 4. Especificação de modelo e diagnóstico	8h	0h	8h
4. OUTROS MÉTODOS DE ESTIMAÇÃO 1. Método de Máxima Verossimilhança 2. Método de Variáveis Instrumentais	8h	0h	8h
5. USO DE VARIÁVEIS BINÁRIAS NO MODELO DE REGRESSÃO 1. Variável Explicativa Binária	6h	0h	6h

A autenticidade deste documento pode ser conferida no site <https://siadoc.ufv.br/validar-documento> com o código: GJO4.XXDU.SYEG

2. Variável Dependente Binária			
6. MODELOS MULTIEQUACIONAIS 1. Modelo de Equações Aparentemente Não-relacionadas (Modelos SUR) 2. Modelos de Equações Simultâneas	6h	0h	6h
7. ANÁLISE DE SÉRIES TEMPORAIS 1. Conceito de Estacionariedade 2. Função de Autocorrelação e Função de Autocorrelação Parcial 3. Teste de Raiz Unitária 4. Modelos VAR 5. Co-integração e Modelo de Correção de Erro	10h	0h	10h
8. ANÁLISE DE DADOS EM PAINEL 1. Modelo de efeitos fixos 2. Modelo de efeitos aleatórios	6h	0h	6h
Total	60h	0h	60h

Teórica (T); Prática (P); Total (To);

ERU 626 - ECONOMETRIA

Bibliografias básicas

Descrição	Exemplares
GREENE, William H. Econometric analysis. 5th. ed. Upper Saddle River, N.J.: Prentice Hall, 2003. 1026 p.	4
GUJARATI, Damodar N.; PORTER, Dawn C. Econometria básica. 5. ed. Rio de Janeiro: AMGH, 2011. xxiv, 924 p.	9
VERBEEK, Marno. A guide to modern econometrics. Chichester [Inglaterra]: New York [Estados Unidos]: Wiley, 2002. xii, 386 p.	3

Bibliografias complementares

Descrição	Exemplares
BAUM, C. F. An introduction to modern econometrics using Stata. College Station, Texas, USA: Stata Press, 2006. 341p	1
CAMERON, A. C.; TRIVEDI, P. K. Microeconometrics Using Stata. Revised Edition. Texas: Stata Press, 2010, 706 p.	3
ENDERS, W. Applied Econometric Time Series. 4ª ed. New York: John Wiley, 2015. 433p.	1
HAYASHI, Fumio. Econometrics. Princeton, Princeton University Press, 2000. 683p.	1
JOHNSTON, Jack; DINARDO, John. Econometric methods. 4th ed. New York [Estados Unidos]: McGraw-Hill, 1997. xviii, 531 p.	2
JUDGE, G, HILL, Carter, GRIFFITHS, W. LUTKEPOHL, H.. 2 ed. Introduction to the theory and practice of Econometrics. New York, Wiley, 1988. 1024p.	1
LÜTKEPOHL, H. e KRÄTZIG, M. Applied Time Series Econometrics. Cambridge: Cambridge University Press, 2004. 323p.	1
MADDALA, G. S. Introdução à Econometria. 3 ed. Rio de Janeiro: LTC Editora, 2003. 345p.	7
PINDYCK, R. S. & Rubinfeld, D. L. Econometria: Modelos e Previsões. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004. 726p.	3
WOOLDRIDGE, J. Introdução à Econometria: uma abordagem moderna. São Paulo: Pioneira Thomson Learning, 2006. 684p.	14
WOOLDRIDGE, Jeffrey M. Econometric analysis of cross section and panel data. Cambridge, Massachusetts [Estados Unidos]: MIT Press, 2002. xxi, 752 p	5