
	UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA INSTITUTO DE ECONOMIA CURSO DE GRADUAÇÃO BACHARELADO EM CIÊNCIAS ECONÔMICAS	
-----------------------------------------------------------------------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------

FICHA DE DISCIPLINA

DISCIPLINA: Econometria				
CÓDIGO: IEUFU41051		UNIDADE ACADÊMICA: Instituto de Economia - IEUFU		
PERÍODO/SÉRIE: 5º período		CH TOTAL TEÓRICA: 60	CH TOTAL PRÁTICA: 0	CH TOTAL: 60
OBRIGATÓRIA: (X)	OPTATIVA: ()			

OBS:

PRÉ-REQUISITOS:

CÓ-REQUISITOS:

OBJETIVOS

O curso permitirá ao aluno um contato com os temas econométricos mais avançados que vão além dos tópicos básicos e que tem muita utilização em aplicações contemporâneas. Para isto foram selecionados dentro da imensa variedade destes tópicos, alguns temas que irão complementar a formação do aluno em econometria permitindo a ele uma compreensão geral dos diversos métodos e que seja possível discernir na sua prática cotidiana os instrumentais pertinentes a problemas empíricos concretos.

EMENTA

Análise de regressão com dados de séries temporais. Agrupamento de cortes transversais ao longo do tempo: métodos simples de dados de painel. Métodos avançados de dados de painel. Estimação de variáveis instrumentais e mínimos quadrados de dois estágios. Modelos de equações simultâneas. Modelos com variáveis dependentes limitadas e correções da seleção amostral.



DESCRIÇÃO DO PROGRAMA

1. Tópicos Avançados sobre Séries Temporais. Metodologia de Box-Jenkins para Modelos Univariados. Modelos de Função de Transferência e de Análise de Intervenção. Testes de Raízes Unitárias e Co-Integração;
2. Agrupamento de cortes transversais ao longo do tempo;
3. Métodos avançados de dados de painel;
4. Estimação de variáveis instrumentais e mínimos quadrados de dois estágios Modelos de equações simultâneas.
6. Modelos com variáveis dependentes limitadas e correções da seleção amostral.

BIBLIOGRAFIA

Bibliografia básica:

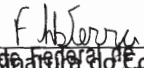
Wooldridge, J.M. 2007. Introdução à Econometria: Uma Abordagem Moderna. São Paulo: Thomson Learning, .
Vasconcelos, M.A.S. e Alves, D. 2000. Manual de Econometria: Nível Intermediário. Editora Atlas.
Kennedy, P. 2009. Manual de Econometria. Editora Campus.
Greene, W., 1993, *Econometric Analysis. Second Edition*, MacMillan.
Statacorp. (2009). Stata Statistical Software: Release 11. College Station. TX: StataCorp LP.

Bibliografia complementar:


Bueno, R.L.S. *Econometria de Séries Temporais*. Cengage Learning Edições Ltda. São Paulo, 2008.
Morettin, P.A. e Toloi, C.M.C. 2004. Análise de Séries Temporais. São Paulo: Edgard Blucher.
Enders, W. 2003. *Applied Econometric Times Series*. John Wiley & Sons Inc.
Materiais didáticos da página: www.ecn26.ie.ufu.br

APROVAÇÃO

16 / 04 / 2010


Universidade Federal de Uberlândia
Carimbo e assinatura do Coordenador do
Curso de Ciências Econômicas
Portaria R nº 780/09

16 / 04 / 2010


Carimbo e assinatura do Diretor da
Unidade Acadêmica
(que oferece a disciplina)
UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA
Prof. Clésio Lourenço Xavier
Diretor do Instituto de Economia
Portaria R nº 674/07