

Curso: Ciências Econômicas | Código: ENEX60991 | Vigência: 2021/1

Nome do Componente Curricular:

Tópicos Avançados de Econometria

Ementa:

O curso discute as consequências da violação dos pressupostos básicos e a tipologia de dados em séries temporais, mediante recurso a softwares econométricos. Apresenta modelos de previsão econômica e a utilização de variáveis instrumentais.

Objetivo:

Apresentar ao aluno a relevância dos principais problemas clássicos de violação das hipóteses para uma estimação confiável, bem como, modelos mais avançados de estimação com base em séries temporais, modelos de previsão e variáveis instrumentais.

Metodologia/Diretivas:

As aulas serão expositivas e críticas, em laboratório, incluindo leituras, pesquisas, debates e seminários referentes ao conteúdo. Os alunos deverão desenvolver pesquisas, resumos e construir material crítico do tema a ser discutido para debates em sala de aula. Prova para conteúdo teórico.

Avaliação:

Prova individual, trabalhos individuais e em grupo, além de seminários ao longo de cada bimestre.

Conteúdo Programático:

UNIDADE I – ANÁLISE DA VIOLAÇÃO DOS PRESSUPOSTOS BÁSICOS

- 1.1. Multicolinearidade
- 1.2. Heterocedasticidade
- 1.3. Autocorrelação serial

UNIDADE II - ERROS DE ESPECIFICAÇÃO

UNIDADE III – SÉRIES TEMPORAIS

- 3.1. A estacionariedade
- 3.2. Testes de estacionariedade.
- 3.3. Regressão Espúria.

Carga Horária: 80 horas

Aulas Semanais:

2 Teóricas/2 Práticas

Etapa: 7

- 3.4. Mecanismo de Correção de Erro.
- 3.5. Os modelos AR, MA, ARMA, ARIMA e VAR.
- 3.6. Os modelos ARCH e GARCH.

UNIDADE IV – VARIÁVEIS INSTRUMENTAIS

Bibliografia Básica:

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. **Introdução à econometria**: uma abordagem moderna. 3. São Paulo Cengage Learning 2018. (Disponível físico e virtual)

ROSSI, J. W.; NEVES, C **Econometria e Séries Temporais** – com aplicações a dados da Economia Brasileira. Rio de Janeiro: LCT, 2014. (Disponível físico e virtual)

GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. **Econometria Básica**. Porto Alegre: AMGH, 2011. (Disponível físico e virtual)

SHRODER, Bruno et. al. **Estatística**: questões comentadas das provas de 2010 a 2019. 7ª ed. Rio de Janeiro: Campus, 2019. Disponível em:
<https://app.minhabiblioteca.com.br/#/books/9788595154513/cfi/6/2!/4/2/2/4@0:0>

Bibliografia Complementar:

PEREDA, P. C., ALVES, D. C. O. **Econometria Aplicada**. Rio de Janeiro: Elsevier, 2018. (Disponível físico e virtual)

BUENO, Rodrigo De Losso da Silveira. **Econometria de séries temporais**. 2. São Paulo Cengage Learning 2018. (Disponível físico e virtual)

MALBOUISSON, Cláudia; FERREIRA TIRYAKI, Gisele (Org.). **Econometria na prática**. Rio de Janeiro: Alta Books, 2017.

BUSCARIOLLI, B.; EMERICK, J. **Econometria com Eviews**. São Paulo: Saint Paul, 2011.

VARTANIAN, P. R.; CIA, Josimar C.; MENDES-DA-SILVA, Wesley. **Econometria**: análise de dados com regressão linear em Excel e Gretl. São Paulo: Saint Paul, 2013.