DISCIPLINA: Tópico Especial: Introdução aos Métodos Econométricos	**CÓDIGO**: PPGA0010
PROFESSOR: Laíse Ferraz Correia	

Nível	Mestrado
Caráter	Não obrigatória
Carga Horária	45
Créditos	3
Área de Concentração	Processos e Sistemas Decisórios
Linha de Pesquisa	Linha 1: Processos e sistemas decisórios em finanças, produção e operações.

Ementa

A disciplina abrange as ferramentas econométricas necessárias para entender estudos empíricos em finanças e para desenvolver projetos de pesquisa nessa área. O tema principal consiste do modelo clássico de regressão linear – especificação, estimação e inferência estatística – e do modelo de regressão generalizado. Os tópicos estudados incluem modelos de regressão simples e múltipla, e regressão com variáveis dependentes binárias; mínimos quadrados ordinários; e mínimos quadrados generalizados, com estimação de parâmetros em dados com heteroscedasticidade e autocorrelação. A disciplina oferece uma breve introdução aos métodos de estimação de regressão de dados em painel, variáveis instrumentais e séries temporais; e ao método de momentos generalizados.

Objetivo

Esta disciplina visa a introdução de modelos econométricos úteis para realizar pesquisas sobre as decisões estratégicas em finanças. O seu principal objetivo é desenvolver as habilidades de analisar dados em finanças; e compreender e aplicar modelos adequados para resolver questões financeiras. Além da abordagem teórica, os estudantes aprenderão a usar softwares econométricos para realizar análise de regressão de dados empíricos. A intenção é fornecer aos alunos o conhecimento e as ferramentas para realizar suas próprias pesquisas empíricas e analisar os resultados.

Interdisciplinaridade

Pré-requisitos	**Código**
Não tem	
Disciplinas para as quais é pré-requisito	
Não tem	

Unidades de ensino		Carga-horária Horas/aula
1	Introdução. O modelo clássico de regressão linear simples. Hipóteses do modelo de regressão linear.	8
2	O modelo de regressão linear múltipla.	8
3	Testes das hipóteses do modelo de regressão.	8
4	Regressão com variável dependente binária.	6
5	Introdução ao modelo de regressão com variáveis instrumentais e ao método de momentos generalizados.	4
6	Introdução ao modelo de regressão de dados em painel.	4
7	Introdução ao modelo de regressão de séries temporais.	4
8	Estudo empírico.	3
	Total	**45**

Metodologias de ensino e aprendizagem

Serão utilizadas as seguintes metodologias:

- Aulas expositivas;
- Aplicação de trabalhos individuais e/ou em grupo;
- Discussão de estudo de casos;
- Seminários de discussão;
- Manuseio de pacote estatístico.

Avaliação da Aprendizagem

A disciplina terá o seguinte critério de avaliação:

- Participação individual (20%)
- Trabalhos, exercícios (30%)
- Prova (50%)

TOTAL: 100 Pontos

Bibliografia

1	ANDERSON, D. R.; SWEENEY, D. J.; WILLIAMS, T. A. **Statistics for business and economics**. 11th ed. Mason: South-Western Cengage Learning, 2011.
2	BAUM, C. **An introduction to modern econometrics using stata.** Stata Press, 2006.
3	BERNDT, E. R. **The practice of econometrics:** classic and contemporary. Addison Wesley Publishing Company, 1991.
4	BROOKS, C. **Introductory econometrics for finance**. 3rd ed. New York: Cambridge University Press, 2014.
5	DHRYMES, P. J. **Mathematics for econometrics**. 4th ed. New York: Springer, 2013.
6	GREENE, W. H. **Econometric analysis**. 7th ed. Pearson, 2011.
7	GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. **Econometria básica.** 5a. ed. AMGH, 2011.
8	GUJARATI, D. N. **Econometrics by example.** 2nd. ed. Palgrave, 2016.
9	HEIJ, C. et al. **Econometric methods with applications in business and economics**. OUP Oxford, 2004.
10	KENNEDY, P. **A guide to econometrics**. 6th ed. Wiley-Blackwell, 2008.
11	HILL, C.; GRIFFITHS, W. E.; LIM, G. C. **Principles of econometrics**. 4th. ed. Wiley,

	2011.
12	STOCK, J.; WATSON, M. M. **Introduction to econometrics.** 3rd ed.. New York: Pearson Education, 2015.
13	WOOLDRIGHE, J. M. **Econometric analysis of cross-section and panel data**. The MIT Press, 2010.
14	WOOLDRIGHE, J. M. **Introductory econometrics:** a modern approach. 5th ed. Mason: South-western Cengage Learning, 2012.