

DISCIPLINA: Tópicos Especiais em Finanças: Métodos Econométricos	CÓDIGO: GT00FIN006.1
---	-----------------------------

VALIDADE: Início: 06/2016

Término:

CARGA HORÁRIA: Total: 60 horas/aula **Semanal:** 04 aulas **Créditos:** 04

Modalidade: Teórica

Classificação do Conteúdo pelas DCN: Formação complementar

Ementa:

Revisão de conceitos básicos em Análise de Regressão. Regressão e Estimadores de Mínimos Quadrados Ordinários. Método de Máxima Verossimilhança. Método dos Momentos Generalizado. Pressupostos do Modelo Clássico de Regressão Linear. Testes de Diagnóstico e Tratamento das violações dos pressupostos: Heterocedasticidade, Autocorrelação e Multicolinearidade. Modelos para Dados em Painel.

Cursos	Período	Eixo	Obrig.	Optativa
Administração	5º / 6º / 7º / 8º	Econômico-Financeiro		X
Engenharia de Produção Civil	9º / 10º			X

Departamento:

Departamento de Ciências Sociais Aplicadas

INTERDISCIPLINARIDADES

Pré-requisitos	Código
O aluno deverá ter integralizado 1440 ou, equivalente 96 créditos no curso	
Co-requisitos	
Disciplinas para as quais é pré-requisito	
Disciplinas para as quais é co-requisito	

Objetivos: *A disciplina deverá possibilitar ao estudante*

Propiciar o conhecimento dos principais métodos econométricos aplicados em Finanças, introduzindo alguns dos métodos mais frequentemente utilizados na literatura recente, com ênfase na aplicação de softwares que possibilitem a condução de estudos empíricos aplicados. Para a assimilação dos métodos de estimação será utilizado o *software* estatístico Stata.

Unidades de ensino		Carga-horária Horas/aula
1	Revisão de Conceitos Básicos de Estatística	6
2	Regressão linear <ul style="list-style-type: none"> • Mínimos Quadrados Ordinários: <ul style="list-style-type: none"> – Pressupostos – Estimação 	10
3	Testes de restrições lineares gerais	10
4	Mínimos Quadrados Generalizados e Método de Máxima Verossimilhança	10
5	Tratamento das violações os pressupostos: <ul style="list-style-type: none"> • Heterocedasticidade, • Autocorrelação • Multicolinearidade 	10
6	Modelos para Dados em Painel	10
7	Aplicação de Métodos Econométricos em Finanças	04
Total		60

Bibliografia Básica

1	FAVERO, L. P. Análise de dados: modelos de regressão com Excel®, Stata® e SPSS®. Rio de Janeiro: Elsevier, 2015.
2	GUJARATI, D. Econometria básica. Rio de Janeiro: McGraw Hill, 2011.
3	STOCK, H. D.; WATSON, M. W. Econometria. São Paulo: Pearson, 2004.

Bibliografia Complementar

1	BAUM, C. F. An introduction to modern econometrics using Stata. Texas: Stata Press, 2006.
2	GREENE, W. Econometric analysis. 7. ed.. USA: MacMillan. 2012.
3	HILL, R. C.; JUDGE, G. G.; GRIFFITHS, W. E. Econometria. 3. ed. São Paulo: Saraiva, 2012.
4	WOOLDRIDGE, J. M. Econometric analysis of cross section and panel data. 2. ed. USA: MIT Press, 2010.
5	WOOLDRIDGE, J. M. Introdução à econometria: uma abordagem moderna. São Paulo: Thomson Learning, 2011.