

DISCIPLINA: Tópicos Especiais em Gestão Aplicada à Engenharia: Métodos Econométricos	CÓDIGO: GT00GAE001.2
---	--------------------------------

VALIDADE: Início: **06/2016**

Término:

Carga Horária: Total: 60 horas/aula Semanal: 4 aulas Créditos: 4**Modalidade:** Teórica**Classificação do Conteúdo pelas DCN:** Específica**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
Engenharia de Produção Civil	9º, 10º	Gestão Aplicada à Engenharia		x

Departamento/Coordenação: Departamento de Ciências Sociais Aplicadas /Coordenação do Curso de Bacharelado em Administração**INTERDISCIPLINARIDADES**

Pré-requisitos	Código
O aluno deverá ter integralizado 2610 horas ou equivalentemente a 168 créditos no curso.	
Co-requisitos	

Objetivos: *A disciplina devesa possibilitar ao estudante*

1	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 • Mínimos Quadrados Ordinários: 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: • Heterocedasticidade, • Autocorrelação • Multicolinearidade	10
6	Modelos para Dados em Painel	10
7	Aplicação de Métodos Econométricos em Finanças	4
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.