



UNIVERSIDADE FEDERAL DO ESPÍRITO SANTO
Centro de Ciências Jurídicas e Econômicas
Secretaria Unificada de Pós-Graduação
Programa de Pós-Graduação em Ciências Contábeis – PPGCON

PROGRAMA DE DISCIPLINA

Disciplina: Tópicos em Econometria	Código: PCON 1061
Carga horária: 30 horas	Créditos: 2

1. EMENTA:

Modelos de Escolha Qualitativa (logit, probit, tobit). Regressão com Dados em Pannel. Método do Momentos Generalizados. Análise de séries temporais. Experimentos naturais. Regressão Quantílica. OBS: os conteúdos que compõem a ementa desta disciplina podem sofrer modificações, pois a mesma tem como objetivo abordar os métodos quantitativos aplicado ao que os discentes irão precisar para o desenvolvimento dos projetos de dissertação.

2. OBJETIVOS:

- Desenvolver os aspectos conceituais, técnicos, ferramentais e operacionais dos métodos econométricos necessários a realização de pesquisas e elaboração de artigos acadêmicos na área de contabilidade.
- Identificar aplicações das ferramentas econométricas em trabalhos de pesquisa relacionados à sua área de interesse.

3. BIBLIOGRAFIA:

BÁSICA:

GUJARATI, D. N. Econometria Básica: 4ª Edição. Rio de Janeiro. Elsevier- Campus, 2006.
LEVINE, D. M., et al. Estatística: Teoria e aplicações, Ed. LTC, Rio de Janeiro, 5ª. Edição, 2008.

COMPLEMENTAR:

ANGRIST, D. J.; PISCHKE, Jörn-Steffen. Mostly harmless econometrics. Princeton: Princeton University, 2009.
CAMPBELL, J.; LO A.; MACKINLAY, A.; The Econometrics of Financial Markets.
GREENE, W.; Econometric Analysis. Prentice-Hall. 2002
HAMILTON, J.; Time Series Analysis. Princeton University Press, 1994
HAYASHI, F.; Econometrics. Princeton University Press. 2000
STEVENSON, W.J. Estatística aplicada à administração. São Paulo: Harbra, 2001.
STEVENSON, W. J. Estatística aplicada à administração. São Paulo: Harper & Row do Brasil, 1981.
WOOLDRIDGE, J.; Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data. MIT Press, 2001