



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

<b>Disciplina:</b> Tópicos em Econometria	<b>Código:</b> PCON 1061
<b>Carga horária:</b> 30 horas	<b>Créditos:</b> 2

### 1. EMENTA:

Modelos de Escolha Qualitativa (logit, probit, tobit). Regressão com Dados em Painel. 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: 4<sup>a</sup> Edição. Rio de Janeiro. Elsevier- Campus, 2006.

LEVINE, D. M., et al. Estatística: Teoria e aplicações, Ed. LTC, Rio de Janeiro, 5<sup>a</sup>. 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