Ementa

Regressão simples e múltipla sob hipóteses básicas; Metodologia em econometria; Mínimos Quadrados Ordinários; Inferência na Análise de Regressão; Regressão Simples e Múltipla relaxando as hipóteses básicas (Heterocedasticidade, Autocorrelação e Multicolinearidade); Endogeneidade e o método de Variáveis Instrumentais; Métodos dos Momentos Generalizados e a Máxima Verossimilhança; Modelos com variável dependente binária (Modelo de Probabilidade Linear, Probit e Logit); Dados em Painel.

Objetivos

Apresentar alguns dos principais modelos que podem ser utilizados na econometria. O curso busca capacitar os alunos no uso e interpretações de modelos econométricos nas diversas temáticas sejam com dados mais agregados ou com microdados.

Programa

1) Conceitos Iniciais

Referências Básicas: Greene (2012) [capítulo 1 e apêndice] e Johnston e Dinardo (1997) [capítulo 1].

Referências complementares: Gujarati e Porter (2011) [capítulos 1 e 2], Wooldridge (2016) [capítulo 1].

2) Modelos de regressão linear e o estimador de Mínimos Quadrados Ordinários

Referências Básicas: Greene (2012) [capítulos 2-4] e Johnston e Dinardo (1997) [capítulos 1-3].

Referências complementares: Gujarati e Porter (2011) [capítulos 3; 5-7; 9] e Wooldridge (2016) [capítulos 2-3; 6-7].

3) Testes de hipótese e seleção de modelos

Referências Básicas: Greene (2012) capítulo 5 e Johnston e Dinardo (1997) capítulo 3.

Referências complementares: Gujarati e Porter (2011) [capítulos 4-5; 8 e 13] e Wooldridge (2016) [capítulo 4]

4) Heterocedasticidade, Autocorrelação e Modelos Lineares Generalizados

Referências Básicas: Greene (2012) [capítulos 9 e 20] e Johnston e Dinardo (1997) [capítulos 5 e 6].

Referências complementares: Gujarati e Porter (2011) [capítulos 11 e 12] e Wooldridge (2016) [8 e 12].

5) Endogeneidade, Variáveis Instrumentais e Mínimos Quadrados em Dois Estágios

Referências Básicas: Greene (2012) [capítulo 9] e Wooldridge [capítulos 5 e 6].

Referências complementares: Wooldridge (2016) [capítulo 15].

6) Dados em Painel

Referências Básicas: Greene (2012) [capítulo 11], Wooldridge (2010) [capítulo 10] e Johnston e Dinardo (1997) [capítulo 12].

Referências complementares: Gujarati e Porter (2011) [capítulo 16] e Wooldridge (2016) [capítulos 13 e 14].

7) Método dos Momentos Generalizados e Máxima Verossimilhança

Referências Básicas: Greene (2012) [capítulos 13 e 14] e Jhonston e Dinardo (1997) [capítulos 5 e 10].

8) Modelos de escolha discreta: Probit e Logit

Referências Básicas: Greene (2012) [capítulo 17], Wooldridge (2010) [capítulo 15] e Jhonston e Dinardo (1997).

Referências complementares: Gujarati e Porter (2011) [capítulo 15] e Wooldridge (2016) [capítulo 17].

Avaliação

A avaliação consiste em duas provas escritas com questões objetivas e subjetivas, e, um trabalho empírico que visa observar a capacidade na parte prática da disciplina, no que se refere à utilização de softwares (Eviews, Stata e/ou R), busca de dados e interpretação de modelos econométricos.

Referências Bibliográficas

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

CAMERON, A. C.; TRIVEDI, P. K. **Microeconometrocs Using Stata.** Stata, 2010.

GREENE, W. **Econometric analysis**. 7º ed. Edition. Boston: Pearson Education, 2012.

JOHNSTON, J.; DINARDO, J. M. **Econometric Methods**. 4a. Edition. New York McGraw-Hill International Editions, 1997.

WOOLDRIDGE, J. M. **Econometric analysis of cross section and panel data**. 2º ed.MIT, 2010.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

FLORIAN, F. H. **Using R for Introductory Econometrics**. Florian Heiss, 2016.

GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. **Econometria Básica**. 5º ed. Porto Alegre: McGraw-Hill Bookman, 2010.

HAYASHI, F. **Econometrics**. Princeton University Press., 2000

OLIVEIRA, M. M. **Econometria**. Lisboa: Escolar Editora, 2011.

PEREDA, P. C.; ALVES, D. **Econometria Aplicada**. Rio de Janeiro: Elsevier, 2018.

WOOLDRIDGE, J. M. **Introdução à Econometria: uma abordagem moderna**. 3º ed. São Paulo: Cengage Learning, 2016.