

IE/UFRJ

IEE-863 – ECONOMETRIA I (Introdução à Econometria) – 2018/I

Prof. Eduardo P. Ribeiro

Objetivo:

O principal objetivo do curso será prover fundamentos da análise econométrica e técnicas em pesquisa aplicada para fomentar a pesquisa empírica em economia. O curso consistirá de aulas expositivas teóricas e aplicadas, complementadas por apresentações de artigos empíricos e exercícios a serem resolvidos com a utilização de softwares econométricos.

Programa:

I. Introdução:

1.1. Métodos empíricos em economia – efeitos causais e previsão [AP 1];

II. Fundamentos Estatísticos:

2.1. Probabilidade e Densidades de probabilidade marginal e condicional [G.1-5];

2.2. Distribuição amostral e teoria assintótica em funções de V.A. [G.8-11]

2.3. Estimação de parâmetros e propriedades [G.8-13]

2.4. Testes de Hipótese [G.8-13].

III. Modelo Clássico Linear com exogeneidade

3.1. Álgebra de mínimos quadrados e propriedades MRCL [G.15-17, W.4];

3.2. MLE e Inferência [G.18-22, 25, V.6].

3.3. Heterocedasticidade e Autocorrelação [G.26-28 V.4];

IV. Variáveis Explicativas Endógenas e métodos de identificação:

5.1 Var. Instrumentais, Sist. de Equações e a Questão da Identificação [V.5];

5.2 Estratégias Empíricas [AP 2,3 V.10]

Avaliação

A avaliação será baseada em uma média ponderada de duas provas (peso da média simples das provas 70%) e dois trabalhos empíricos (peso da média simples dos trabalhos 30%).

Bibliografia Básica:

*Angrist, J. e J. Pischke (2008). *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*. Princeton University Press.

Davidson, R. and McKinnon, J. (1993). *Estimation and Inference in Econometrics*. New York:Oxford University Press.

Hayashi, F. (2000) *Econometrics*. Princeton:PUP

Cameron, A. e P. Trivedi (2010). *Microeconometrics Using Stata*. Stata Press.

* Goldberger, A. (1991). *A Course in Econometrics*, Harvard University Press.

*Verbeek M. (2001). *A Guide to Modern Econometrics*, 2nd Ed. Wiley.