

DISCIPLINA: **ECONOMETRIA I**

CARGA HORÁRIA: **60h**

CRÉDITOS: **4**

PRÉ-REQUISITO: ESTATÍSTICA ECONÔMICA E INTRODUÇÃO À ECONOMETRIA

PERÍODO: **6º**

CÓDIGO: **IEE233**

OBJETIVO

Este curso tem como objetivo apresentar aos alunos(as) conceitos teóricos fundamentais em econometria e técnicas econométricas básicas utilizadas em pesquisa econômica aplicada. A disciplina privilegia tanto a abordagem formal quanto aplicações em economia. Espera-se que a exposição dos(as) alunos(as) ao longo do curso a técnicas econométricas os(as) capacite a realizar trabalhos empíricos em economia.

EMENTA

Estimação de modelos lineares simples. Propriedades algébricas e estatísticas do estimador de Mínimos Quadrados Ordinários (MQO). Teorema de Gauss-Markov. Hipótese da normalidade, propriedades do MQO sob normalidade e inferência. Estimação de regressão múltipla, propriedades e inferência. Derivação do estimador de MQO e suas propriedades em notação matricial. Heterocedasticidade e autocorrelação. Variações em formas funcionais em pesquisa aplicada: interações, mudanças na unidade de medida de variáveis dependentes e independentes, elasticidades e semi-elasticidades. Variáveis independentes binárias. Estimação por máxima verossimilhança com aplicações sobre modelos de escolha discreta e variáveis dependentes binárias. Tópicos avançados em pesquisa aplicada em microeconometria: introdução à inferência causal, variáveis instrumentais e dados em painel. Tópicos avançados em pesquisa aplicada em séries de tempo: introdução aos fundamentos estatísticos, ciclo de modelagem e previsão.

BIBLIOGRAFIA

GUJARATI, D e D. PORTER. Econometria Básica, 5ª Ed. Rio de Janeiro: Bookman, 2011.

MADDALA, G.S. Introdução à Econometria, 3ª Ed. Rio de Janeiro: LTC, 2003.

STOCK, J. e M. WATSON. Econometria, São Paulo: Pearson, 2004.

WOOLDRIDGE, J. Introdução à Econometria, São Paulo: Thomson, 2005.