
ECONOMETRIA - EMENTA
Prof. Pedro Engel

Ementa:

O objetivo do curso é capacitar o aluno para o desenvolvimento de trabalhos empíricos nas diferentes áreas de economia através do uso de software econométrico R e de técnicas sofisticadas de estatística e econometria.

Ao final do curso, espera-se que o(a) aluno(a) seja capaz de compreender e manipular dados através de software estatístico e ter capacidade de avaliar políticas públicas e testar a validade de modelos econômicos. A econometria se faz fundamental para a aplicação do conhecimento teórico adquirido através dos estudos empíricos. Além disso, a análise de políticas públicas necessita de abordagem estatística desenvolvida na disciplina.

Conteúdo Programático:

Análise de Regressão; O método de mínimos quadrados; Inferência estatística no modelo de regressão linear; Regressão Múltipla; Interpretação dos coeficientes de regressão; problemas de Variáveis omitidas e variáveis irrelevantes; O Coeficiente R²; As estatísticas de Wald e LM; Variáveis Dummy; Violações das suposições do modelo de regressão linear; Heterocedasticidade; Multicolinearidade; endogeneidade e variável instrumental; Introdução a séries de tempo.

Bibliografia

Wooldridge, J. Introductory Econometrics: a modern approach. Thomson, 2003
Florian Heiss. Using R for Introductory Econometrics. CreateSpace Independent Publishing Platform; Edição: 1 (5 de fevereiro de 2016)
Stock, James and Watson, Mark. Introduction to Econometrics. Prentice Hall, 3rd edition, 2016.
HAYASHI, Fumio. Econometrics. Princeton University Press, 2000