

Econometria

O curso de Econometria I apresenta ao aluno de graduação um conjunto de técnicas econométricas comumente utilizadas em estudos empíricos em economia. Conhecimento de Cálculo, Probabilidade e Estatística é um requisito para o curso. Na primeira parte serão abordados temas fundamentais em análise de regressão, tais como: modelo de regressão linear (simples e múltipla), estimação, método de mínimos quadrados ordinários, interpretação dos parâmetros da regressão, coeficiente de determinação R^2 , inferência, teoria assintótica, formas funcionais não lineares, variáveis explicativas binárias, heterocedasticidade, validade interna/externa, entre outros temas. Na segunda parte do curso serão abordados tópicos mais avançados e que comumente também são vistos em aplicações de econometria, tais como: modelos de dados em painel, endogeneidade e variáveis instrumentais, modelos com variáveis dependentes limitadas (e o método da Máxima Verossimilhança), Inferência Causal, GMM, introdução às séries temporais, entre outros tópicos. O curso combina aulas expositivas, com uma abordagem aplicada, nas quais os modelos vistos em sala serão implementados utilizando-se a linguagem R. Para avaliar o aprendizado dos alunos, o curso conta com provas, trabalhos e listas de exercícios. Mais detalhes (i.e., objetivos, conteúdo, aprendizagem, avaliação, bibliografia) podem ser encontrados a seguir.

INFORMAÇÕES BÁSICAS

☐ **Carga horária:** 60

☐ **Pré-requisitos:** Estatística

BIBLIOGRAFIA

Obrigatória:

- ☐ WOOLDRIDGE, Jeffrey M. Introductory Econometrics – A Modern Approach. 6th Edition, Cengage Learning.
- ☐ STOCK, James H.; WATSON, Mark W. Introduction to econometrics. 2015.
- ☐ FLORIAN HEISS. Using R for Introductory Econometrics. 2nd edition, 2020. Independent Publishing.