



Faculdade de Economia, Administração e Contabilidade
Departamento de Economia

Disciplina: EAE0324 - Econometria I

Objetivos: A disciplina de Econometria é essencial para consolidar a formação de qualquer economista, pois – dentre outras utilidades – apresenta-se como uma importante ferramenta de análise empírica da teoria econômica. Pretende-se, ao final do curso, que os alunos sejam capazes de especificar, estimar e interpretar modelos econométricos, preparando-os para o aprendizado de técnicas mais avançadas nos cursos subsequentes, assim como nas demais disciplinas do curso.

Docente: Denisard Alves.

Horário de atendimento: **Terças e quintas das 11h00 às 12h00 na sala 120C do FEA 1 (não enviar email, pois não será respondido).**

Monitores: Adriano Teixeira.

Programa:

1. Introdução:
 - a. Revisão de Estatística Básica;
 - b. Formulação de modelos e análise empírica;
 - c. Dados experimentais vs dados observados;
 - d. Causalidade vs Correlação.

2. Regressão Linear Simples e Múltipla:
 - a. Estimador pelo Método dos Momentos;
 - b. Estimador de MQO;
 - Unidades de medida;
 - Formas funcionais;
 - Valores estimados, erro, resíduo, qualidade de ajuste;
 - Valores esperados e Variâncias dos Estimadores MQO;
 - Inferências e testes de hipótese: teste t, teste F;
 - Hipóteses e propriedades do estimador: Teorema de Gauss Markov;
 - Viés de variável omitida;
 - Variáveis explicativas binárias (variáveis *dummyies*);
 - Propriedades assintóticas do estimador: Consistência, Normalidade assintótica e inferência em grandes amostras;
 - c. Estimador de Máxima Verossimilhança.

3. Regressão Múltipla – alguns problemas da econometria clássica:
 - a. Heterocedasticidade;
 - b. Autocorrelação serial;
 - c. Problemas de especificação, problemas de erro de medida, amostras não aleatórias;
 - d. Tópicos.

Avaliação:

Duas provas (P1 com peso 25% e P2 com peso 40%), listas de exercícios (peso 15%), provinhas/quiz* (peso 10%) e trabalho final de curso (10% de peso). Aprovação com nota igual ou superior a 5,0 e mínimo de 70% de frequência. Não haverá prova substitutiva. Os alunos com 70% ou mais de frequência e média final entre 3,0 e 4,99, poderão fazer prova de reavaliação. Alunos com média final superior a 5,0 terão a média normalizada (essa regra não inclui os alunos que irão para reavaliação, nem os reprovados por nota e frequência).

Datas das Provas:

- 1ª prova (P1): 27/04/2017 (primeira parte da matéria);
- 2ª prova (P2): 29/06/2017 (toda a matéria);
- Prova de reavaliação: 13/07/2017 (toda a matéria).

* Poderão ser aplicadas provas surpresas condicionais a comportamento em sala de aula e ao conteúdo ministrado. O quiz também será aplicado nas aulas de monitoria.

Média para alunos em reavaliação: Média aritmética simples entre a média final e a nota da Recuperação igual ou superior a 5 (cinco), mantida a exigência de frequência mínima de 70%.

Bibliografia Básica:

ANGRIST, J. D. & PISCHKE J. (2009) Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion. Princeton University Press.

ANGRIST, J. D. & PISCHKE J. (2014) Mastering 'Metrics: The Path from Cause to Effect. Princeton University Press.

CAMERON, C & TRIVEDI, P. K. (2010) Microeconometrics Using Stata. Stata Press.

GUJARATI, D.N. (2006). Econometria Básica. Campus Editora.

STOCK, J. e WATSON, M. (2012) Introduction to Econometrics. Pearson, 3ª edição.

WOOLDRIDGE, J.M. (2010) Introdução a Econometria: uma abordagem moderna. 5ª edição norte-americana. Cengage Learning.