



Faculdade de Economia, Administração e Contabilidade
Departamento de Economia

Disciplina: EAE0324 - Econometria I

Objetivos: A disciplina de Econometria é essencial do aprendizado de um economista. Este curso tem como objetivo ensinar os alunos a analisarem e interpretarem modelos econômicos de regressão linear, bem como proporcionar ferramentas que possibilitem a estimação e inferência sobre os parâmetros desses modelos. Ao final do curso, os alunos devem estar preparados para o aprendizado de técnicas mais avançadas nos cursos subsequentes, assim como nas demais disciplinas do curso.

Docente: Paula Carvalho Pereda.

Horário de atendimento: Quinta-feira das 18h30 às 19h30 na sala 218 do FEA 2 (não enviar email).

Monitores: Bernardo Ostrovski e Igor Barreto.

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. Estimação por vários métodos
 - i. Método dos Momentos
 - ii. MQO
 - iii. Máxima Verossimilhança
 - b. Valores estimados, erro, resíduo, qualidade de ajuste
 - c. Hipóteses clássicas e propriedades dos estimadores
 - i. Não-viés
 - ii. Eficiência (Teorema de Gauss-Markov)
 - iii. Consistência
 - d. Especificações
 - i. Unidades de medida
 - ii. Formas funcionais
 - iii. Uso de variáveis dummy
 - e. Distribuição de probabilidades dos estimadores
 - i. Distribuição exatas

- ii. Distribuição assintótica
- f. Inferência
 - i. Testes de hipóteses individuais
 - ii. Testes de hipóteses múltiplas
- 3. Violações das hipóteses clássicas:
 - a. Heterocedasticidade e autocorrelação serial
 - b. Correção do estimador da variância
 - c. Estimadores MQP e MQPF

Avaliação:

Duas provas (P1 com peso 30% e P2 com peso 40%), listas de exercícios e provinhas/quiz* (peso conjunto de 30%). 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 poderão ter a média normalizada (se esse for o caso, a regra não inclui os alunos que irão para reavaliação, nem os reprovados por nota e frequência).

Datas das Provas:

- 1ª prova (P1): 03/10/2017 (primeira parte da matéria);
- 2ª prova (P2): 28/11/2017 (toda a matéria);
- Prova de reavaliação: 12/12/2017 (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.