Econometria I – REC 2301 Prof. Daniel D. Santos

**Ementa**

Objetivo: Introduzir o conceito de regressão e ensinar as técnicas de Mínimos Quadrados Ordinários e Generalizados

Primeira parte: Concepção de um exercício empírico

- Regressão e causalidade

- Estrutura dos dados e fontes de variação

- Estratégias de estimação

- Expectativas Iteradas

Segunda Parte: Mínimos Quadrados

 - Distribuição Normal e suas propriedades

 - Mínimos Quadrados Ordinários: modelo linear e estimação

 - Mínimos Quadrados Ordinários: inferência

 - Regressão curta versus regressão longa

 - Mínimos Quadrados Generalizados: heterocedasticidade, estimação e inferência

Bibliografia:

 - Notas de aula \*

 - Wooldridge, J. Introdução à Econometria: uma abordagem moderna \*

 - Gujarati, D. Econometria Básica

 - Davidson, R. and J. Mac Kinnon. Econometric Theory and Methods

 - Stock, J. e M. Watson. Econometria

Avaliação:

 - Testes curtos durante a aula, quinzenalmente às terças-feiras. Na metade do mês o teste será mais simples, e no fim do mês, mais elaborado. Cada sequência vale 30% do resultado final, sendo que no caso dos testes elaborados o pior resultado é descartado para cômputo da nota. Os testes podem requerer o uso do software R para estimação de modelos. O pior resultado é descartado (média dos três melhores testes). (60%)

 - Auto-correção dos testes utilizando o seguinte critério: a cada acerto confirmado pelo aluno, +1 ponto. A cada erro computado como acerto pelo aluno, -0,5 ponto. (40%).