

Ementa:

A disciplina tem como objetivo apresentar os fundamentos teóricos e práticos da análise econométrica. Aborda os modelos de regressão linear clássico e a violação dos seus pressupostos. Modelos de escolha discreta, modelo com variável dependente censurada ou truncada, painel de dados estático e dinâmico.

Programa:

1. Revisão de estatística e probabilidade
 - 1.1 Variáveis aleatórias discretas e contínuas
 - 1.2 Distribuições teóricas de probabilidade
 - 1.3 Teorema Central do Limite e Lei dos Grandes Números
2. Modelo clássico de regressão linear
 - 2.1 Método de mínimos quadrados ordinários (MQO)
 - 2.2 Propriedades dos estimadores de MQO em pequenas amostras
 - 2.3 Propriedades dos estimadores de MQO em grandes amostras
3. Violação dos pressupostos do modelo de regressão linear
 - 3.1 Heterocedasticidade, Autocorrelação e Método dos Mínimos Quadrados Generalizados (MQG)
 - 3.2 Multicolinearidade
 - 3.3 Endogeneidade, Variáveis Instrumentais e Método dos Mínimos Quadrados em Dois Estágios (MQ2E)
4. Modelos de escolha discreta
 - 4.1 Estimador de Máxima Verossimilhança (EMV)
 - 4.2 Modelo Probit
 - 4.3 Modelo Logit
5. Modelos com dados censurados ou truncados
 - 5.1 Variáveis Censuradas e Truncadas
 - 5.2 Modelo Tobit
 - 5.3 Modelo de Dois Estágios de Heckman
6. Painel de dados estático e dinâmico
 - 6.1 Modelos de Efeitos Fixos e Aleatórios
 - 6.2 Estimador de Método de Momentos Generalizados (GMM)
 - 6.3 Métodos de Painel de Dados Dinâmico (System-GMM e Difference-GMM)

Avaliação:

A avaliação da disciplina será por meio de listas de exercícios (10%), atividades em sala (20%), prova (35%) e trabalho (35%).

Referências:

Cameron, A. Colin and Pravin K. Trivedi. Microeconometrics: Methods and Applications. Cambridge University Press, 2005.

Greene, William H. Econometric Analysis, 7th ed., Pierson Education, 2011.

Wooldridge, Jeffrey M. Introductory Econometrics: A Modern Approach, 4th ed., South-Western College, 2008.

Cameron, A. Colin and Pravin K. Trivedi. Microeconometrics Using Stata, Revised Edition. Stata Press, 2010.