

Programa de Pós Graduação da Faculdade de Economia da UFF

Programa de Econometria (60 horas) – 1º. Semestre de 2022

Profa. Danielle Carusi Machado – dcarusi@id.uff.br

Objetivo do curso de Econometria

- Apresentar as técnicas e métodos econométricos básicos, capacitando o aluno a entender, analisar e elaborar trabalhos empíricos simples na área de economia.
- Treinar os alunos na utilização da teoria, por meio de exercícios analíticos e de exercícios aplicados resolvidos em microcomputador (Pacotes econométricos sugeridos: R, Stata)

Pontos gerais do curso:

1. Introdução à análise econométrica, revisão de álgebra linear no contexto de RLM
2. MQO, propriedades algébricas, propriedades estatísticas, Teorema Gauss Markov
3. Modelo de RLM Clássico, Inferência, Predição: testes de hipóteses e de especificação.
4. Aplicações: variáveis binárias, interações, formas quadráticas, RLM com restrições.
5. Problemas do Modelo Clássico: heterocedasticidade/ MQG/ testes para heterocedasticidade
6. Problemas do Modelo Clássico: viés (erro de medida, variáveis omissas, endogeneidade). Variáveis instrumentais, MQ2E.
7. Modelos de variáveis discretas: probit, logit, multinomial
8. Seleção Amostral, modelos de Heckman
9. Introdução a Séries Temporais.

Bibliografia Básica:

- Greene, William H. Econometric Analysis. Sixth Edition. Pearson Prentice Hall. 2008.
- Enders, Walter (1995) Applied Econometric Times Series.

Bibliografia Complementar:

- Wooldridge, J.M (2005). Introdução à Econometria: uma abordagem moderna, 1ª. Ed. Editora Thomson Learning.
- Verbeek, Marno. (2008) A Guide to Modern Econometrics. John Wiley & Sons, Ltd.
- Angrist, Joshua D. ; Pischke, Jorn-Steffen. Mostly Harmless Econometrics: an empiricist's Companion. March, 2008.

- Gujarati, D. N.; Porter, D. C. Econometria Básica. 5ª. Edição.

Avaliação:

- Serão aplicadas **duas provas e listas de exercícios ao longo do curso** (individual ou em grupo).

Seguem abaixo as datas destas verificações:

Prova 1: 4 de abril

Prova 2: 30 de maio

Prova Final: a decidir

Exercícios: listas ou pequenos exercícios ao longo do curso (podem ser exercícios aplicados).

- Nota final: $0,8 * (\text{média das provas}) + 0,2 * (\text{nota das listas})$

Caso o aluno não obtenha média superior ou igual a 6,0, será aplicada uma verificação final seguindo as regras estipuladas pela UFF.

- **Atenção: De acordo com o regulamento do PPGE, a reprovação em qualquer disciplina implica perda de bolsa. Portanto, atenção às regras de avaliação.**