

DISCIPLINA MESTRADO: ECONOMETRIA APLICADA

Carga horária Total: 60 horas

Disciplina Obrigatória

DOCENTE RESPONSÁVEL: Prof. Dr. Raphael Almeida Videira

DOCENTES: Prof. Dr. Alexandre Ripamonti; Prof. Dr. Raphael Almeida Videira

EMENTA:

Apresentação das informações disponíveis nos mais diversos bancos de dados. Análise das hipóteses e construção do modelo de regressão linear simples. Revisão de álgebra matricial e elaboração do modelo de regressão múltipla. Estudo de questões associadas à multicolinearidade, heterocedasticidade e autocorrelação. Análise de resultados com a inclusão de uma variável dummy em tais modelos. Introdução aos modelos de séries temporais e de dados em painel.

OBJETIVOS:

Ao final do curso o aluno deverá ser capaz de:

- Compreender a existência e a aplicação das mais diversas bases de dados;
- Utilizar softwares econométricos para análises estatísticas;
- Perceber as diferenças entre as técnicas econométricas apresentadas;
- Analisar criticamente os resultados de um modelo econométrico, bem como, as medidas de ajuste e os resíduos

METODOLOGIA:

A estrutura que será utilizada nas aulas será mesclada entre aula expositiva, com a aplicação de exercícios e resolução de problemas. Tais problemas podem ser de natureza teórica, bem como aplicações práticas à casos reais.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO COM CRONOGRAMA:

Aula	Conteúdo	Bibliografia
1	- Introdução e Apresentação do Programa - Apresentação de Bases de Dados e Exercícios Introdutórios	- Gujarati - Introdução; - Wooldridge - Capítulo 1
2	- Modelo de Regressão Linear Simples: Hipóteses; Derivação dos Estimadores e Interpretação	- Gujarati - Capítulos 1 - 6; - Wooldridge - Capítulo 2
3	- Modelo de Regressão Linear Múltipla: Hipóteses; Derivação dos Estimadores e Interpretação	- Gujarati - Capítulos 7, 8, 9; - Wooldridge - Capítulo 3; 8 e 12
4	- Autocorrelação, Multicolinearidade, Heterocedasticidade	- Gujarati - Capítulos 10-12; - Wooldridge - Capítulos 8 e 12
5	- Autocorrelação, Multicolinearidade, Heterocedasticidade	- Gujarati - Capítulos 10-12; - Wooldridge - Capítulos 8 e 12

6	- Introdução à Análise de Séries Temporais	- Gujarati - Capítulos 21 e 22; - Wooldridge - Capítulo 18
7	- Metodologia de Box-Jenkins	- Gujarati - Capítulos 21 e 22; - Wooldridge - Capítulo 18
8	- VAR, VEC e Cointegração	- Gujarati - Capítulos 21 e 22; - Wooldridge - Capítulo 18
9	- Introdução à Análise de Dados em Painel	- Gujarati - Capítulo 16; - Wooldridge - Capítulos 13 e 14
10	- POLS, Efeitos Fixos e Efeitos Aleatórios	- Gujarati - Capítulo 16; - Wooldridge - Capítulos 13 e 14
11	Apresentação dos Trabalhos	

AValiação de Aprendizagem com Instrumentos Aplicados

- a) Exercícios em Sala – 30%:
 - a. Este instrumento visa a capacitação e o treinamento em relação às técnicas e conceitos transmitidos em sala de aula. Deste modo, espera-se que o aluno consiga implementar técnicas econométricas das mais diversas em seus trabalhos acadêmicos.
- b) Trabalho (Pré-Projeto) – 20%
- c) Trabalho Final – 50%
 - a. Tanto o item “b” como o item “c” pretendem se tornar uma aplicação prática de conceitos transmitidos na sala de aula, com o objetivo de proporcionar a geração de pesquisa acadêmica nos mais diversos temas, porém com o uso de métodos econométricos.

REFERÊNCIAS

Obrigatórias

Gujarati, Damodar N. (2019). *Econometria*. Saraiva.

Sartoris, Alexandre. (2013). *Estatística e introdução à econometria*. Saraiva.

Wooldridge, Jeffrey M. (2017). *Introdução à econometria: uma abordagem moderna*. Cengage Learning.

Complementares

Asteriou, Dimitrios; Hall, Stephen G. (2007). *Applied Econometrics: a modern approach*. Palgrave Macmillan.

Bussab, Wilton de Oliveira; Morettin, Pedro Alberto. (2001) *Estatística básica*. Atual.

Enders, Walter. (2008). *Applied econometric time series*. John Wiley & Sons.

Heij, Christiaan et al. (2004). *Econometric methods with applications in business and economics*. Oxford University Press.

Hill, R. Cater. et al. (2000). *Econometria*. Saraiva.

Matos, Orlano Carneiro de. (2000). *Econometria básica: teorias e aplicações*. Atlas.

Sartoris, Alexandre. et al. (2000). *Manual de econometria: nível intermediário*. Atlas.

Stock, J. H. & Watson, M. W. (2003). *Introduction to Econometrics*. Addison Wesley.

Wooldridge, Jeffrey M. (2010). *Econometric analysis of cross section and panel data*. MIT Press.