

Econometria I

PIMES/UFPE

2023.2

E-mail: henrique.fonseca@ufpe.br

Office Hours: agendamento por email

Office: 7_(^)_/7

Web: henriqueveras.github.io/econometrics

Class Hours: Ter-Qui (14:00 - 16:00)

Class Room: Sala C-6

Descrição

O curso cobrirá modelos, bem como métodos de identificação e estimativa usados na econometria moderna. O curso explora alguns dos principais modelos de econometria, suas estruturas bem como métodos de identificação, estimativa e inferência. Os tópicos incluem modelos de regressão linear, inferência estatística, variáveis instrumentais, modelos de resposta qualitativa e dados de painel.

Bibliografia

Greene, William H (2012). *Econometric Analysis 8th ed.* Pearson Education, Inc.

Leitura Complementar

Cameron, A Colin and Pravin K Trivedi (2005). *Microeconometrics: methods and applications.* Cambridge university press.

Davidson, Russell, James G MacKinnon, and others (2004). *Econometric theory and methods.* Vol. 5. Oxford University Press New York.

Políticas do Curso

Para criar um ambiente de aprendizado eficaz para todos os alunos, por favor, chegue pontualmente às aulas e evite comportamentos que possam ser perturbadores para os colegas. As discussões em sala de aula devem ser respeitadas tanto com os colegas quanto com pontos de vista divergentes.

Os slides das aulas serão disponibilizados na página do curso.

Frequência às aulas é extremamente recomendada. Todos os alunos são assumidos estarem cientes de qualquer anúncio feito em sala de aula, mesmo quando os mesmos não estejam presentes.

Prova de segunda chamada será realizada unicamente nos casos previstos no regimento da Universidade. Os alunos deverão seguir os procedimentos descritos no regimento para solicitar segunda chamada. A segunda chamada inclui todo o material do semestre.

Solicitações de revisão de prova devem ser feitas por escrito de acordo com o regimento do PIMES. Toda a prova será reavaliada, isto implica que a nota pode aumentar, cair ou permanecer a mesma.

Avaliações

- 80% da nota será composta por dois exames (não-cumulativos) com pesos iguais.
- 20% da nota será composta por listas de exercícios distribuídas ao longo do semestre.

Programa

1. O Modelo de Regressão Linear (Capítulo 2)
2. Regressão por Mínimos Quadrados (Capítulos 3, 4, 5 6)
3. Endogeneidade e Variáveis Instrumentais (Capítulo 8)
4. Heteroscedasticidade (Capítulo 9)
5. Modelos de Dados em Paineis (Capítulo 11)
6. Modelos de Resposta Qualitativa (Capítulo 17)
7. Método dos Momentos Generalizado (Capítulo 13)
8. Estimação por Máxima Verossimilhança (Capítulo 14)