

UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARANÁ

PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM DESENVOLVIMENTO
ECONÔMICO

Econometria

*Professor Victor Rodrigues de Oliveira**

1 Objetivo

A Econometria é o estudo unificado de modelos econômicos, estatística e dados econômicos. O objetivo é apresentar conceitos fundamentais e estabelecer as propriedades estatísticas dos principais estimadores lineares em econometria. Espera-se que, ao final do curso, o aluno tenha uma base sólida de fundamentos em econometria.



2 Método Didático

As aulas serão expositivas com debates e demonstrações de todos os resultados matemáticos. É esperado que o aluno interessado em participar desta disciplina tenha em sala de aula uma postura ativa ou pelo menos curiosa para que o conteúdo do curso seja enriquecedor para suas ideias e visão de mundo.

3 Programa

1. Expectativa Condicional e Projeção
2. Regressão por MQO
3. Propriedades de Convergência Fraca para Funções de Grandes Amostras
4. Estimação Restrita
5. Testes de Hipóteses
6. Variáveis Instrumentais
7. Estimador de Máxima Verossimilhança
8. Modelos de Escolha Discreta
9. Dados em Painel
10. Regressão Quantílica

*E-mail: victoroliv.rod@ufpr.br

4 Avaliação

1. Duas provas individuais (peso 2/3): 9/5 e 27/6
2. Lista de exercícios (peso 1/3)

5 Referências

1. Greene, W. Econometric Analysis. 8ª edição. Pearson. 2018.
2. Hyashi, F. Econometrics. Princeton University Press, 2000.
3. Wooldridge, J. Econometric Analysis of Cross-Section and Panel Data. 2ª edição. The MIT Press, 2010.
4. Lehmann, L. E. Elements of Large-Sample Theory. Springer. 1999.
5. Davidson, R. e MacKinnon, J. G.. Econometric Theory and Methods. Oxford University Press, 2004.
6. Angrist, J. D. e Pischke, J-S. Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion. Princeton University Press, 2009.
7. Hansen, B. E. Econometrics. Princeton University Press, 2020.
8. Vaart, A. W. van der . Asymptotic Statistics. Cambridge University Press, 1998.
9. Ruud, P. A. An Introduction to Classical Econometric Theory. Oxford University Press. 2000.
10. Wooldridge, J. Introductory Econometrics: A Modern Approach. 7ª edição. Cengage Learning, 2019.
11. James, H. S. e Mark, W. W. Introduction to Econometrics. 3ª edição. Pearson India. 2017.
12. Cunningham, S. Causal Inference: The Mixtape. Yale University Press, 2021.
13. Stachurski, J. A Primer in Econometric Theory. The MIT Press, 2017.
14. McCloskey, Deirdre Nansen. Economical Writing, Third Edition: Thirty-Five Rules for Clear and Persuasive. University of Chicago Press, 3ª edição, 2019.
15. Backhouse, Roger E., e Steven G. Medema. 2009. "Retrospectives: On the Definition of Economics". Journal of Economic Perspectives, 23(1): 221–233.
16. Berk, Jonathan B., Campbell R. Harvey, e David Hirshleifer. 2017. "How to Write an Effective Referee Report and Improve the Scientific Review Process". Journal of Economic Perspectives 31(1): 231–244.
17. Bayer, Amanda, and Cecilia Elena Rouse. 2016. "Diversity in the Economics Profession: A New Attack on an Old Problem". Journal of Economic Perspectives 30(4): 221–242.
18. Conley, John P., e Ali Sina Onder. 2014. "The Research Productivity of New PhDs in Economics: The Surprisingly High Non-success of the Successful". Journal of Economic Perspectives 28(3): 205–216.