

## **Programa de Pós Graduação da Faculdade de Economia da UFF**

Programa de Econometria (60 horas) – 1º. Semestre de 2023

Profa. Danielle Carusi Machado – [dcarusi@id.uff.br](mailto: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. Teoria assintótica
6. Problemas do Modelo Clássico: heterocedasticidade/ MQG/ testes para heterocedasticidade
7. Problemas do Modelo Clássico: viés (erro de medida, simultaneidade, variáveis omissas, endogeneidade). Variáveis instrumentais, MQ2E.
8. Modelos de variáveis discretas: probit, logit, multinomial
9. Seleção Amostral, modelos de Heckman
10. Introdução a Séries Temporais.

### **Bibliografia Básica:**

- Greene, William H. Econometric Analysis. Sixth Edition. Pearson Prentice Hall. 2008.

### **Bibliografia Complementar:**

- Wooldridge, J.M (2005). Introdução à Econometria: uma abordagem moderna, 1ª. Ed. Editora Thomson Learning.
- Pereda, P, Alves, D. Econometria Aplicada. Elsevier. 2018
- 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 **três provas e listas de exercícios ao longo do curso** (individual ou em grupo).

Seguem abaixo as datas destas verificações:

Prova 1: 15 de março

Prova 2: 10 de abril

Prova 3: 22 de maio

Prova Final: 29 de maio (matéria toda)

Exercícios: listas ou pequenos exercícios ao longo do curso (podem ser exercícios aplicados). Para listas não entregues, a nota é zero.

- 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 Prova 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.**