

Notas de Aulas de Econometria

Marcos Minoru Hasegawa

2020-09-14

Sumário

Licença	5
Sobre o material	7
Sobre o Autor	9
1 Propriedades de amostra finita do MQO	11
1.1 O modelo regressão linear clássico	11
2 Literature	13
3 Methods	15
4 Applications	17
4.1 Example one	17
4.2 Example two	17
5 Final Words	19

Licença

Como está descrito no repositório, os poucos códigos originais desenvolvidos ao longo do texto estão sob a licença **GNU GPLv3** .

O texto e as artes gráficas elaboradas de forma original estão sob licença **Creative Commons BY-NC-SA 4.0**.

Sobre o material

A situação especial causada pela pandemia da COVID-19 forçou a muitos professores criarem materiais para facilitar aulas remotas das suas disciplinas. A disciplina SE308 Econometria da UFPR não poderia ser diferente. Então, o objetivo deste material é de suprir a falta das bibliografias básicas na sua versão digital com a disponibilização de forma digital e gratuita o que seria o material das notas das aulas da disciplina de Econometria. Não é o ideal, mas a ideia é melhorar o material com tempo.

Sobre o Autor

Professor do Departamento de Economia da Universidade Federal do Paraná. Engenheiro Agrônomo pela UNESP/Jaboticabal, Mestrado em Economia Agrária pela ESALQ/USP e Doutorado em Economia Aplicada pela ESALQ/USP, é um dos professores responsáveis pelas disciplinas de SE305 Estatística Econômica e Introdução à Econometria e SE308 Econometria ambas do curso de Economia da Universidade Federal do Paraná (UFPR).

Capítulo 1

Propriedades de amostra finita do MQO

No capítulo 1 apresenta as propriedades de pequena amostra ou amostra finita do estimador de mínimos quadrados ordinários. Como a maior parte deste material, o primeiro o capítulo 1 tem como base Hayashi (2000).

1.1 O modelo regressão linear clássico

O modelo de regressão linear clássico, as variáveis, chamadas de variável dependente ou regressanda é relacionada com outras várias variáveis denominadas regressoras ou variáveis explicativas. Suponha que se observe n valores para estas variáveis. Seja y_i a i -ésima observação da variável dependente em questão e seja $(x_{i1}, x_{i2}, x_{i3}, \dots, x_{iK})$ as i -ésimas observações dos K regressores. A **amostra** ou **dado** é a um coleção destas n observações.

Capítulo 2

Literature

Here is a review of existing methods.

Capítulo 3

Methods

We describe our methods in this chapter.

Capítulo 4

Applications

Some *significant* applications are demonstrated in this chapter.

4.1 Example one

4.2 Example two

Capítulo 5

Final Words

We have finished a nice book.

Referências Bibliográficas

Hayashi, F. (2000). *Econometrics*. Princeton University Press, New Jersey, 1 edition.