

Econometria – ENCE – Semestre 2010.01

Professora Mônica Barros

Homepage: www.mbarros.com

e-mails: monicabarros@uol.com.br, monica.barros@ibge.gov.br

Horários de atendimento: 3as e 6as – 18 às 18:40. Agendar atendimento fora deste horário.

Programa do curso

O programa segue, em linhas gerais (mas não na mesma ordem) aquele contido na homepage da ENCE.

O livro texto (de uso OBRIGATÓRIO) a ser adotado neste semestre é o GUJARATI, ECONOMETRIA BÁSICA, 4ª EDIÇÃO. O material a ser coberto no curso abrange os capítulos 7 a 22 do livro, além do Apêndice C.

Além dos exercícios teóricos, parte da sua nota será composta por um GRANDE projeto prático, que poderá ser executado no software ou linguagem computacional de sua preferência (R, SAS, Matlab, Eviews, Stata, etc), para o qual um relatório técnico deverá ser executado. Outros projetos menores serão feitos ao longo do curso.

As datas das provas e entrega do trabalho são:

1ª. VAE – 07 de maio – 6ª feira

Entrega do trabalho – 24 a 25 de junho – 5ª ou 6ª feira – vale 60% da nota da 2ª. VAE – Por que a opção de entrega em 2 dias? Jogo do Brasil na Copa em 25/06.

2ª. VAE – 06 de julho – 3ª feira

Exame Final – 13 de julho – 3ª feira

Outras avaliações – leituras, resumos, material extra. Serão enviados à medida que eu encontrar coisas interessantes para mandar para vocês.

O trabalho deverá ser entregue em formato IMPRESSO E EM CD usando o modelo de relatório sugerido. NÃO SERÃO ACEITOS TRABALHOS ENTREGUES APENAS POR E-MAIL. O trabalho poderá ser feito em grupos de 2 alunos no máximo.

Referências adicionais

JOHNSTON, J. & DiNardo, J.; Métodos Econométricos. McGraw-Hill, 4ª edição, 2001.

WOOLDRIDGE, J.M. (2003): Introductory Econometrics: A Modern Approach, 2ª Ed., South-Western College Publishing.

ENDERS, W.; Applied Econometrics Time Series; Wiley, 1995.

MADALA, G. S.; Introduction to Econometrics; Prentice-Hall, 1992, second edition.

JUDGE, George et al. The theory and practice of econometrics. 2ª edition. New York: Wiley, 1985.

HILL, R.C., GRIFFITHS, W.E., & JUDGE, G.G. (2001). Undergraduate Econometrics. (2nd Edition). John Wiley and Sons.

PINDYCK, R.S. & RUBINFELD, D.L. - Econometric Models and Economic Forecasts, 1998, 4th. Edition, McGraw-Hill.

Programa Sequencial do Curso

- 1) Apêndice C – Modelo de regressão linear em forma matricial
- 2) Capítulo 7 – Regressão Múltipla – o problema da estimação
- 3) Capítulo 8 – Regressão Múltipla – o problema da inferência
- 4) Capítulo 9 – Regressão com variáveis binárias
- 5) Capítulo 10 – Multicolinearidade
- 6) Capítulo 11 – Heterocedasticidade
- 7) Capítulo 12 – Autocorrelação
- 8) Capítulo 13 – Especificação do Modelo
- 9) Capítulo 14 – Modelos de Regressão Não Lineares
- 10) Capítulo 15 – Modelos de Escolha Qualitativa, Logit, Probit, Tobit e Poisson
- 11) Capítulo 16 – Modelos com Dados em Painel
- 12) Capítulo 17 – Modelos AR e com defasagens distribuídas
- 13) Capítulo 18 – Modelos de Equações Simultâneas
- 14) Capítulo 19 – O Problema da identificação – simultaneidade, exogeneidade
- 15) Capítulo 20 – Métodos de equações simultâneas
- 16) Capítulo 21 – Econometria de Séries temporais – raiz unitária, regressão espúria, teste de Dickey-Fuller, co-integração
- 17) Capítulo 22 - Econometria de Séries temporais – previsão, modelos AR, MA, ARMA, ARIMA, VAR, modelos para a volatilidade, ARCH, GARCH

Notas de aula

Serão muito breves, incompletas e restritas – NÃO CONTE COM ELAS. DESTA VEZ, O SEU MELHOR AMIGO É O LIVRO – leia-o!

Eventualmente irei escanear algum material extra que considere interessante e colocá-lo na minha homepage.