

ECONOMETRIA

Ementa

Análise de regressão linear simples e multivariada. Inferência nos modelos de regressão. Principais problemas nos modelos de regressão. Análise de regressão não linear. Heterocedasticidade e autocorrelação. Multicolinearidade. Matrizes de correlação. Fatores de inflação de variância (VIFs). Equações simultâneas. Modelos de variáveis qualitativas.

Temas

1. Regressão linear simples
2. Regressão linear múltipla
3. Problema da autocorrelação e heterocedasticidade
4. Multicolinearidade e equações simultâneas
5. Modelos de variáveis qualitativas

Referências bibliográficas

- GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. Econometria Básica. Porto Alegre: AMGH, 2011.
- HAUSMAN, J. A. Specification tests in econometrics. *Econometrica: Journal of the Econometric Society*, v. 46, n. 6, p. 1251-1271, 1978.
- PINDYCK, R. S.; RUBINFELD, D.L. Econometria: modelos e previsões. 4. ed. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004.
- SARTORIS, A. Estatística e Introdução à Econometria. São Paulo: Saraiva, 2017.
- STOCK, J. H.; YOGO, M. Testing for weak instruments in linear IV regression. In: ANDREWS, D.; STOCK, J. (ed.). *Identification and Inference for Econometric Models: Essays in Honor of Thomas Rothenberg*. Cambridge: Cambridge University Press, 2005.
- STOCK, J. H.; WATSON, M. W. *Introduction to Econometrics*. 3. ed. Boston: Pearson; Addison-Wesley, 2011.
- WOOLDRIDGE, J. M. *Introdução à econometria. Uma abordagem moderna*. São Paulo: Pioneira Thomson Learning, 2006.
- WHITE, H. A heteroskedasticity-consistent covariance matrix estimator and a direct test for heteroskedasticity. *Econometrica: Journal of the Econometric Society*, p. 817-838, 1980.
- VASCONCELLOS, M. A. S.; ALVES, D. (ed.). *Manual de econometria*. São Paulo: Atlas, 2000.
- OULIARIS, S. What is econometrics? *Finance & Development*, dez. 2011. Disponível em: <https://www.imf.org/external/pubs/ft/fandd/2011/12/pdf/b2b.pdf>. Acesso em: 13 mar. 2023.