



PROGRAMA

BIBLIOGRAFIA

- HOFFMANN, R. Estatística para Economistas, 3ª ed., São Paulo, Editora Pioneira, 1998.
- HOFFMANN, R. e VIEIRA, S. Análise de Regressão: uma Introdução à Econometria, 3ª ed. São Paulo, Editora HUCITEC, 1998 (o livro está esgotado, mas uma versão preliminar de nova edição estará disponível em forma de apostila).
- HOFFMANN, R. Análise Harmônica, ESALQ, DEAS, Série Didática nº 99, 1995.
- HILL, C; GRIFFITHS, W. e JUDGE, G. Econometria, São Paulo, Saraiva, 1999.
- JOHNSTON, J. e DINARDO, J. Econometric Methods, 4ª ed., McGraw-Hill, Internacional Editions, 1997.
- WONNACOTT, R. J. e WONNACOTT, T. H. Econometria, Rio de Janeiro, Livros Técnicos e Científicos, 1976.
- LANGE, O. Introdução à Econometria, 2º ed. Rio de Janeiro, Fundo de Cultura, 1967.
- MADDALA, G. S. Introduction to Econometrics, Macmillan, 1988.

Os Símbolos no final de cada item indicam os capítulos correspondentes, com A representando o livro “Análise de Regressão” e H representando o livro de Hill et alii.

1. Introdução: Econometria e Economia; modelos H1.
2. Revisão de conceitos estatísticos básicos: variável aleatória, distribuição, Esperança matemática, amostra, parâmetros e estimadores, métodos de obtenção de estimadores, propriedades dos estimadores (incluindo propriedades assintóticas) e teste de hipóteses. A1 e H2.
3. Correlação e Regressão Linear Simples. A2-3 e H3-6.
Observação: A partir do próximo item supõe-se que o aluno conheça álgebra de matrizes (vetores e Matrizes; soma, multiplicação, transposição e inversão de matrizes; característica ou posto de uma matriz).
4. Regressão Linear Múltipla. A4 e H7-8.
5. Uso de variáveis binárias. A5 e H9.
6. Heterocedasticia. A6 e H10.
7. Autocorrelação nos erros. A7 e H11.
8. Equações simultâneas. A9 e H13.
9. Séries Temporais. A10 e H16.