



Universidade Presbiteriana

Mackenzie

CCSA - Centro de Ciências Sociais e Aplicadas

Programa de Pós-Graduação em Economia e Mercados

PLANO DE ENSINO

Unidade Universitária: CCSA - Centro de Ciências Sociais e Aplicadas		
Programa de Pós-Graduação: PPGECON – Programa de Pós-Graduação em Economia e Mercados		
Curso: <input type="checkbox"/> Mestrado Acadêmico <input checked="" type="checkbox"/> Mestrado Profissional <input type="checkbox"/> Doutorado		
Disciplina Estatística Econômica e Econometria		
Professor(es): Prof. Dr. Pedro Raffy Vartanian		
Carga horária: 48 h/a	Créditos 4	<input checked="" type="checkbox"/> Obrigatória <input type="checkbox"/> Optativa <input type="checkbox"/> Eletiva
Ementa: Apresentação de Dados e Estatística Descritiva. Exame de questões relacionadas às variáveis aleatórias. Estudo das distribuições de probabilidade e discussão sobre probabilidade condicional. Explicitação da Lei dos Grandes Números. Estudo do Teorema Central do Limite. Aplicação de técnicas de estimação. Aprofundamento em testes de hipóteses. Compreensão e utilização de modelos lineares. Introdução aos testes de raízes unitárias. Compreensão das questões relacionadas à exogeneidade e causalidade. Estudo sobre Vetor Auto-regressivo e Cointegração. Aplicação do Método dos Momentos Generalizados. Análise de regressão com dados em painel. Utilização de variáveis dependentes binárias. Análise de regressão de séries temporais e previsão. Introdução à estimação de efeitos causais dinâmicos.		
Conteúdo Programático: Apresentação de dados e estatística descritiva. Aplicação de técnicas de estimação. Aprofundamento em testes de hipóteses. Compreensão e utilização de modelos lineares. Introdução aos testes de raízes unitárias. Compreensão das questões relacionadas à exogeneidade e causalidade. Estudo sobre Vetor Auto-regressivo e Cointegração. Aplicação do Método dos Momentos Generalizados. Análise de regressão com dados em painel. Utilização de variáveis dependentes binárias. Análise de regressão de séries temporais e previsão. Introdução à estimação de efeitos causais dinâmicos.		
Critério de Avaliação Segundo Regulamento Geral da Pós-Graduação Stricto Sensu, Art. 98: A – excelente: corresponde às notas no intervalo entre os graus 9 e 10; B – bom: corresponde às notas no intervalo entre os graus 8 e 8,9; C – regular: corresponde às notas no intervalo entre os graus 7 e 7,9; R – reprovado: corresponde às notas no intervalo entre os graus 0 e 6,9”		



Universidade Presbiteriana

Mackenzie

CCSA - Centro de Ciências Sociais e Aplicadas

Programa de Pós-Graduação em Economia e Mercados

Bibliografia:

Básica:

GREENE, William H. **Econometric analysis**. 6th ed. Upper Saddle River, N.J.: Pearson Prentice Hall, 2008.

STOCK, James H; WATSON, Mark W. **Econometria**. São Paulo: Pearson/Addison Wesley, 2004. WOOLDRIDGE, Jeffrey M. **Econometric analysis of cross section and panel data**. Cambridge, Mass.: The MIT Press, 2002.

Complementar:

GUJARATI, Damodar N.; PORTER, Dawn C. **Econometria básica**. 5. ed. São Paulo: AMGH, 2012.

HAYASHI, Fumio. **Econometrics**. Princeton, N.J.: Princeton University Press, 2000.

HEIJ, C. **Econometric methods with applications in business and economics**. Oxford: Oxford University Press, 2004.

KENNEDY, Peter. **Manual de econometria**. Rio de Janeiro: Elsevier, c2009.

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. **Introdução à econometria: uma abordagem moderna**. São Paulo: Thomson, 2007.