

Programa de Aperfeiçoamento para Carreiras – 2019

Curso: Introdução à Econometria

Professor: Fausto José Araújo Vieira, Carlos Henrique Coêlho de Andrade e Celso José Costa Júnior

Período: 03, 05, 10, 12, 17, 19, 24 e 26 de setembro de 2019 e 01, 03, 08 e 10 de outubro de 2019.

Horário: 19h00 às 22h00

Carga Horária: 40 horas, sendo 36 presenciais e 4 não presenciais.

Objetivo

Ao final do curso, o participante será capaz de compreender os fundamentos teóricos, conceitos testes relacionados à regressão linear e a sua aplicação em casos concretos. Será capaz, ainda, de fazer regressão linear no software “R” e interpretar os resultados dos principais testes aplicados.

Ementa

Introdução ao R. Estatísticas básicas no R. O modelo de regressão linear clássico: conceito, estimativa, interpretação, inferência e previsão. Coeficiente de determinação. Formas funcionais logarítmicas e elasticidade. Violação das hipóteses clássicas: heteroscedasticidade, multicolinearidade, autocorrelação. Erros de especificação. Regressão com variáveis *dummies*. Exemplos de aplicação de métodos estatísticos e econométricos em pesquisa econômica (uso das bases de dados dos livros do *Gujarati*).

Metodologia de Ensino

Exposição dialogada e aplicação com a realização de regressão e aplicação dos testes aprendidos, com a utilização de software econométrico. Será utilizado o Software “R” para realizar as regressões e aplicar os testes estatísticos relacionados. O curso será realizado com a utilização de computador individual pelos alunos. O curso valoriza a participação e a troca de experiências entre os presentes.

Avaliação

Trabalho em grupo, desenvolvido em sala, conforme os temas indicados nos “seminários temáticos”. A avaliação será realizada a partir das regressões e dos testes estatísticos realizados em sala de aula. O trabalho com a análise dos testes realizados deverá ser enviado para o e-mail: aperfcarreiras@enap.gov.br. O prazo indicativo para envio do trabalho é 18 de outubro de 2019.

PLANO DE AULA**03 de setembro – terça-feira (professor Fausto Vieira)**

<i>19h00 às 20h30</i>	Apresentação do programa do curso Introdução à análise de regressão. Modelo de regressão linear simples: conceitos básicos, propriedades, estimativa e interpretação.
<i>20h30 às 20h45</i>	Intervalo
<i>20h45 às 22h00</i>	Introdução à análise de regressão. Modelo de regressão linear simples: conceitos básicos, propriedades, estimativa e interpretação.

05 de setembro – quinta-feira (professor Henrique Coêlho)

<i>19h00 às 20h30</i>	Introdução ao R e RStudio.
<i>20h30 às 20h45</i>	Intervalo
<i>20h45 às 22h00</i>	Exercícios de regressão linear simples.

10 de setembro – terça-feira (professor Henrique Coêlho)

<i>19h00 às 20h30</i>	Análise de regressão múltipla: conceitos básicos, propriedades, estimativa, interpretação, inferência e previsão.
<i>20h30 às 20h45</i>	Intervalo
<i>20h45 às 22h00</i>	Aplicações e exemplos.

12 de setembro – quinta-feira (professor Fausto Vieira)

<i>19h00 às 20h30</i>	Coeficiente de determinação, intervalos de confiança, testes de hipóteses. Exemplos e Exercícios.
<i>20h30 às 20h45</i>	Intervalo
<i>20h45 às 22h00</i>	Aplicações e exemplos.

17 de setembro – terça-feira (professor Fausto Vieira)

<i>19h00 às 20h30</i>	Formas funcionais logarítmicas, elasticidade e previsão.
<i>20h30 às 20h45</i>	Intervalo
<i>20h45 às 22h00</i>	Exemplos de aplicação de métodos estatísticos e econométricos em pesquisa econômica (uso das bases de dados dos livros do Gujarati e do Wooldridge).

19 de setembro – quinta-feira (professor Celso Costa)

<i>19h00 às 20h30</i>	Violação das hipóteses clássicas: heteroscedasticidade, multicolinearidade e autocorrelação. Erros de especificação.
<i>20h30 às 20h45</i>	Intervalo
<i>20h45 às 22h00</i>	Avaliação dos modelos. Aplicação dos testes. Exemplos.

24 de setembro – terça-feira (professor Fausto Vieira)

19h00 às 20h30	Regressão com variáveis <i>dummies</i> .
20h30 às 20h45	Intervalo
20h45 às 22h00	Aplicações e exemplos.
26 de setembro – quinta-feira (professor Celso Costa)	
19h00 às 20h30	Modelos econométricos – Banco Central e outros
20h30 às 20h45	Intervalo
20h45 às 22h00	Modelos econométricos – Banco Central e outros
01 de outubro – terça-feira (professor Fausto Vieira)	
19h00 às 20h30	Introdução aos modelos econométricos dinâmicos. Tendência e sazonalidade.
20h30 às 20h45	Intervalo
20h45 às 22h00	Exemplos de aplicação de métodos estatísticos e econométricos em pesquisa econômica (uso das bases de dados dos livros do Gujarati e do Wooldridge).
03 de outubro – quinta-feira (professor Henrique Coêlho)	
19h00 às 20h30	Modelos de dois estágios e variáveis instrumentais. Simulações e exemplos
20h30 às 20h45	Intervalo
20h45 às 22h00	Exemplos de aplicação de métodos estatísticos e econométricos em pesquisa econômica (uso das bases de dados dos livros do Gujarati e do Wooldridge).
08 de outubro – terça-feira (professor Fausto Vieira)	
19h00 às 20h30	Introdução à Econometria de Séries de tempo
20h30 às 20h45	Intervalo
20h45 às 22h00	Exemplos de aplicação de métodos estatísticos e econométricos em pesquisa econômica (uso das bases de dados dos livros do Gujarati e do Wooldridge).
10 de outubro – quinta-feira (professor Henrique Coêlho)	
19h00 às 20h30	Introdução à Econometria de Dados em Painel
20h30 às 20h45	Intervalo
20h45 às 22h00	Exemplos de aplicação de métodos estatísticos e econométricos em pesquisa econômica (uso das bases de dados dos livros do Gujarati e do Wooldridge).

Bibliografia Básica:

GUJARATI, Damodar N. e e D. PORTER. Econometria Básica, 5ª Ed. Rio de Janeiro: Bookman, 2011.

WOOLDRIDGE, J. Introdução à Econometria. São Paulo: Thomson, 2005.

Bibliografia Complementar:

BANCO CENTRAL DO BRASIL. Dez Anos de Metas para a Inflação no Brasil. 1999-2009.

BUENO, Rodrigo L. S. Econometria de séries temporais. São Paulo: Cengage Learning, 2015.

GREENE, William H. Econometric Analysis. 5ª Ed. Prentice Hall, 2003.

GUJARATI, Damodar N. Econometria Básica. Makron Books Ltda, 2000.

HAMILTON, James. Time Series Analysis. Princenton University Press, 1994.

SHUMWAY, Robert e STOFFER, David. Time Series Analysis and Its Applications with R Examples. New York: Springer, 2011.

BANCO CENTRAL DO BRASIL. Trabalhos para discussão BCB. Disponível em <<http://www.bcb.gov.br/pec/wps/port/default.asp>>.

ASSOCIAÇÃO NACIONAL DOS CENTROS DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA. Trabalhos aceitos nos congressos da ANPEC. Disponível em <<http://www.anpec.org.br/novosite/br/encontros>>.

NATIONAL BUREAU OF ECONOMIC RESEARCH. NBER working papers. Disponível em <<http://www.nber.org/papers>>.

Professores



Fausto José Araújo Vieira

Mestrado e doutorado pela Escola de Economia de São Paulo da Fundação Getúlio Vargas (EESP-FGV). Foi Coordenador-Geral de Política Macroeconômica da Secretaria de Planejamento e Assuntos Econômicos do Ministério do Planejamento. Atualmente é Coordenador Geral de Projeções Econômicas da Secretaria de Política Econômica do Ministério da Economia. Tem experiência na área de econômica de algumas instituições financeiras, com foco na análise de indicadores macroeconômicos e estimação/projeção dessas séries.



Carlos Henrique Coêlho de Andrade

Mestrado em Economia pela Universidade Federal da Paraíba e doutorado em Economia pela Universidade Federal do Rio Grande do Sul. Foi pesquisador e economista na Diretoria de Estratégia e Organização do Banco do Brasil. Atualmente é analista na Coordenação Geral de Projeções Econômicas da Secretaria de Política Econômica do Ministério da Economia e faz parte da equipe de desenvolvimento do software econométrico Gretl. Tem experiência na área de macroeconomia e de econometria aplicada, com ênfase em séries temporais e softwares estatísticos e econométricos.



Celso José Costa Júnior

Pós-Doutorado na Escola de Economia de São Paulo EESP/FGV, Doutor em Desenvolvimento Econômico pela UFPR, Mestre em Economia pela Unesp/Ar, MBA em Negócios Financeiros pela PUC-Rio e Bacharel em Geofísica IAG-USP. Atualmente é Coordenador Geral de Modelagem Econômica da Secretaria de Política Econômica do Ministério da Economia. Também é pesquisador associado do Centro Macro Brasil (EESP-FGV) e professor adjunto da Universidade Estadual de Ponta Grossa. É autor do livro *Understanding DSGE models* (Vernonpress, 2016) e tem como linha de pesquisas os modelos do tipo DSGE.