

Universidade de Brasília
Departamento de Economia

ECO-132918 – Economia Estatística

Quartas e Sextas, 10-12h

Prof. Victor Gomes

Home Page: *www.victorgomes.com.br*

Email: *victorgomes@unb.br*

Pré-req: ECO-132012 – Introdução a Economia e
EST-115444 – Introdução à Estatística Econômica

Programa

Ementa

A disciplina "Economia estatística" tem por objetivo familiarizar os estudantes com ferramentas estatísticas necessárias para ser utilizado no curso de econometria e na sua vida profissional. Espera-se que ao final do curso de econometria e na sua vida profissional. Espera-se que ao final do curso, o estudante esteja apto a inferir a partir de amostras, montar testes de hipóteses, obter regressões simples, fazer projeções e interpretar economicamente as estatísticas obtidas.

Bibliografia

O livro-texto do curso é o de Wooldridge (2006). Como alternativa ao livro-texto sugerimos o livro de Stock e Watson (2005), de onde posso retirar algum tópico.

Software

Existem muitos softwares no mercado para se trabalhar com econometria. Entre os principais estão: *Gauss, Matlab, Eviews, Limdep, Rats, R, S-Plus, SAS* e *Stata* – ou mesmo pode se utilizar programas para linguagem de baixo nível como *Fortran* ou *C*. O curso não possui um modo específico de trabalho com software, mas sempre faremos menção à implementação empírica dos resultados econométricos.

Avaliações e Menções

A avaliação do curso consiste em duas provas, uma aplicada no meio e outra no final. Cada prova possui um peso de 50% na nota final.

Cronograma

Conceitos Básicos

1. Revisão de estatística descritiva e probabilidade

Distribuições de Probabilidade

2. Distribuições de probabilidade simples e conjuntas, função de densidade de distribuição, marginal e condicionada para variáveis discretas e contínuas.
3. Distribuições de probabilidade teóricas discretas e contínuas.

Modelo de Regressão

4. Natureza dos dados em econometria
5. Modelo de regressão linear simples
6. Modelo de regressão linear múltipla

Teste de Hipótese: Inferência

7. Conceitos básicos
8. Inferência econométrica

Introdução à Teoria Econométrica

9. Princípios estatísticos: conceitos e teoremas
10. Consistência
11. Normalidade e inferência assintótica

Problemas Adicionais em Regressão

12. Forma funcional
13. Seleção de regressores e previsão

Bibliografia

- Stock, James H. e Mark W. Watson. *Econometria*. São Paulo: Pearson - Addison-Wesley, 2005.
- Wooldridge, Jeffrey M. *Introdução à Econometria: Uma Abordagem Moderna*. São Paulo: Thomson Learning, 2006.