

Conteúdo Programático, Bibliografia (indicação opcional) e Sistematização da Prova Prática (quando houver)

Edital UFRJ nº 54, de 30 de janeiro de 2024

Haverá Prova Prática: () Sim (X) Não

Unidade			
Código da Opção de Vaga	MC-084	Departamento ou Programa / Setorização Definitiva	Ciências Econômicas / Métodos Quantitativos com ênfase em econometria
Conteúdo Programático	<ol style="list-style-type: none">1. Modelo de regressão linear multivariado clássico: estimação por mínimos quadrados e inferência. Propriedades dos estimadores em pequenas e grandes amostras. Estimadores da Variância Robustos à Heterocedasticidade e à Autocorrelação. Aplicações à Economia.2. Modelos com variáveis dependentes binárias, ordinais e limitadas. Aplicações à Economia.3. Estimação por Máxima Verossimilhança e Método Generalizado dos Momentos. Motivação e propriedades. Aplicações à Economia.4. Modelos causais de resultados potenciais. Efeito médio de tratamento geral (ATE), nos tratados (ATT) e nos não tratados (ATU). Diferença de média e sua relação com ATT e com o viés de seleção. Hipóteses para identificação causal. Experimentos aleatórios. Aplicações à Economia.5. Variáveis instrumentais. Estimação e identificação. Mínimos quadrados em dois estágios. Estimador de Wald para instrumento binário. Instrumentos fracos. Efeito médio local do tratamento (LATE). Validade interna e validade externa. Aplicações à Economia.6. Modelos de dados em painel e diferenças em diferenças com efeito de tratamento homogêneo e heterogêneo. Entrada única e entradas múltiplas. Estudo de evento. Estimação e hipóteses para identificação. Aplicações à Economia.7. Modelos de controle sintético. Construção do controle sintético e hipóteses para identificação. Inferência. Testes de robustez mais comuns. Aplicações à Economia.8. Desenho de regressão descontínua. Estimação e Identificação. Descontinuidade sharp e descontinuidade fuzzy. Testes de robustez mais comuns. Aplicações à Economia.9. Séries não-estacionárias, testes de raiz unitária, estimação de modelos com processos integrados. Previsão. Modelos de vetores auto-regressivos (VAR) e de correção de erros (VECM). Aplicações à Economia.		

	10. Modelos de Espaço-estado: Especificações, estimação e propriedades. Modelos de suavização exponencial. Filtro de Kalman. Aplicações à Economia.
Bibliografia (indicação opcional)	Não indicada.
Sistematização da Prova Prática	----