

Lego II: Tópicos em Análise de Dados Quantitativos (3 créditos)

Prof. Nelson do Valle Silva e Arnaldo Lôpo Mont'Alvão Neto

Horário: quartas-feiras, das 9 às 12 horas

Consultas: a combinar com os professores

1) Revisão de Estimação Estatística

- 1.1 – Distribuições de probabilidades; esperança matemática
- 1.2 – Distribuições amostrais
- 1.3 – Critérios para estimadores; métodos de estimação
- 1.4 – Testes de hipóteses; diferenças entre médias e entre proporções

2) Regressão Simples

- 2.1 – Modelo
- 2.2 – Estimação

3) Violação de Pressupostos Básicos

- 3.1 – Não-normalidade
- 3.2 – Variância constante
- 3.3 – Não linearidade

4) Estimação com Dados Deficientes

5) Regressão Múltipla

- 5.1 – Modelo e estimação
- 5.2 – Multicolinearidade
- 5.3 – Erros de especificação
- 5.4 – Regressores binários
- 5.5 – Seleção de modelos

6) Modelos de Variáveis Dependentes Binárias: Regressão

Logística

Bibliografia Básica

KMENTA, Jan. (1986), *Elements of Econometrics* (2ª ed.). New York, McMillan.

GUJARATI, Damodar N. (2003), *Basic Econometrics* (4ª ed.). New York, McGraw Hill.

KENNEDY, Peter. (1992) *A Guide to Econometrics* (3ª ed.). Cambridge, MIT Press.

HOSMER JR., David W. e LEMESHOW, Stanley. (1989), *Applied Logistic Regression*. New York, Wiley & Sons.