

Econometria Computacional

Nome da disciplina: Econometria Computacional – 4 créditos.

Professor: Helton Saulo - EST/UnB

Email: heltonsaulo@gmail.com

Web: <https://heltonsaulo.github.io/site/>

Objetivo

O objetivo é trazer alguns tópicos recentes de pesquisa em econometria com ênfase na implementação computacional.

Software

O software R (www.R-project.org) será utilizado para programação. O \LaTeX e/ou R Markdown deverá ser utilizado para digitação das listas e trabalho da disciplina.

Ementa (sujeito à mudança)

- (1) Otimização e máxima verossimilhança
- (2) Algoritmo EM
- (3) Monte Carlo
- (4) Bootstrap e Jackknife
- (5) Modelos de regressão para dados inflacionados de zero
- (6) Modelos de regressão para dados censurados à esquerda
- (7) Modelos de regressão quantílica
- (8) Modelos de duração para dados de alta frequência

Avaliação

TBA.

Referências bibliográficas

- Artigos publicados na área
- Greene, W. H. (2012). *Econometric Analysis*. Pearson Education, seventh edition.
- Boehmke, B., Greenwell, B. (2020). *Hands-On Machine Learning with R*. Boca Raton: CRC Press.
- Davino, C., Furno, M., and Vistocco, D. (2014). *Quantile Regression*. Chichester: Wiley.
- Givens, G.H., Hoeting, J.A. (2013) *Computational Statistics*, 2nd Ed., New Jersey: John Wiley & Sons.
- Rizzo, M.L. (2019) *Statistical Computing with R*. Boca Raton: Chapman & Hall/CRC.
- Robert, C.P., Casella, G. (2010) *Introducing Monte Carlo Methods with R*. New York: Springer.