

---

CURSO: Graduação em Economia – 1º Semestre de 2021  
DISCIPLINA: Econometria I  
PROFESSOR(ES): Pedro Engel  
MONITOR: Filipe Fiedler  
CARGA HORÁRIA: 60h  
PRÉ-REQUISITO: Estatística  
HORÁRIO E SALA DE ATENDIMENTO: quinta-feira de 14 às 16 hs.  
SALA: 201.1 (FGV CERJ)

## PLANO DE ENSINO

### 1. Ementa

Análise de Regressão; O método de mínimos quadrados; Inferência estatística no modelo de regressão linear; Regressão Múltipla; Interpretação dos coeficientes de regressão; inferência; problemas de Variáveis omitidas e variáveis irrelevantes; O Coeficiente R<sup>2</sup>; As estatísticas de Wald e LM; Variáveis Dummy; Violações das suposições do modelo de regressão linear; Heterocedasticidade; Multicolinearidade; endogeneidade e variável instrumental; Introdução a variáveis dependentes binárias.

### 2. Objetivos da disciplina

O objetivo do curso é capacitar o aluno para o desenvolvimento de trabalhos empíricos nas diferentes áreas de economia através do uso de software econométrico R e de técnicas sofisticadas de estatística e econometria.

### 3. Objetivos centrais de aprendizagem

Ao final do curso, espera-se que o(a) aluno(a) seja capaz de compreender e manipular dados através de software estatístico e ter capacidade de avaliar políticas públicas e testar a validade de modelos econômicos.

### 4. Relação da disciplina com o debate contemporâneo

A econometria se faz fundamental para a aplicação do conhecimento teórico adquirido através dos estudos empíricos. Além disso, a análise de políticas públicas necessita de abordagem estatística desenvolvida na disciplina.

## 5. Procedimentos de ensino (metodologia)

O procedimento de ensino é de aulas expositivas com teoria e exemplos. Ao longo do curso, serão passados exercícios para casa de modo a facilitar o aprendizado através da fixação de conceitos e do desenvolvimento de pensamento crítico. Para complementar o aprendizado do aluno, serão realizadas aulas aplicadas no laboratório.

## 6. Conteúdo programático detalhado

<b>Datas</b>	<b>Tópico</b>	<b>Atividades</b>
<b>Aula 1</b>	<b>Análise de Regressão Simples</b>	<b>Cap 2</b>
<b>Aula 2</b>	<b>Análise de Regressão Simples</b>	<b>Cap 2</b>
<b>Aula 3</b>	<b>Análise de Regressão Múltipla</b>	<b>Cap 3</b>
<b>Aula 4</b>	<b>Análise de Regressão Múltipla</b>	<b>Cap 4</b>
<b>Aula 5</b>	<b>Análise de Regressão Múltipla</b>	<b>Cap 4</b>
<b>Aula 6</b>	<b>Teoria Assintótica</b>	<b>Cap 5</b>
<b>Aula 7</b>	<b>Teoria Assintótica</b>	<b>Cap 5</b>
<b>Aula 8</b>	<b>Análise com variáveis independentes discretas</b>	<b>Cap 7</b>
<b>Aula 9</b>	<b>Análise com variáveis independentes discretas</b>	<b>Cap 7</b>
<b>Aula 10</b>	<b>Problemas de Heteroscedasticidade</b>	<b>Cap 8</b>
<b>Aula 11</b>	<b>Problemas de Heteroscedasticidade</b>	<b>Cap 8</b>
<b>Aula 12</b>	<b>Outros problemas de especificação</b>	<b>Cap 9</b>
<b>Aula 13</b>	<b>Outros problemas de especificação</b>	<b>Cap 9</b>
<b>Aula 14</b>	<b>Variáveis Instrumentais</b>	<b>Cap 15</b>
<b>Aula 15</b>	<b>Variáveis Instrumentais</b>	<b>Cap 15</b>
<b>Aula 16</b>	<b>Modelos de Equações simultâneas</b>	<b>Cap 16</b>
<b>Aula 17</b>	<b>Modelos de Equações simultâneas</b>	<b>Cap 16</b>
<b>Aula 18</b>	<b>Modelos com Variáveis dependentes limitadas</b>	<b>Cap 17</b>
<b>Aula 19</b>	<b>Modelos com Variáveis dependentes limitadas</b>	<b>Cap 17</b>
<b>Aula 20</b>	<b>Modelos com Variáveis dependentes limitadas</b>	<b>Cap 17</b>
<b>Demais Aulas</b>	<b>Revisão e aulas práticas</b>	<b>Exercícios de Fixação</b>

## 7. Procedimentos de avaliação

A nota final do aluno será dividida igualmente em 2 partes: prova 1 (7 pts) e lista(s) de exercícios (3 pontos), prova 2 (7 pontos) e lista(s) de exercícios (3 pontos).

## 8. Bibliografia Obrigatória

STOCK, James and WATSON, Mark. *Introduction to Econometrics*. Prentice Hall, 3rd edition.

WOOLDRIDGE, J.. *Introductory Econometrics: a modern approach*. Thomson, 2003

Florian Heiss. *Using R for Introductory Econometrics*. CreateSpace Independent Publishing Platform; Edição: 1 (5 de fevereiro de 2016)

## 9. Bibliografia Complementar

GREENE, W.. *Econometric Analysis*. Prentice Hall, 2003

JEFFREY, M. Wooldridge. *Introductory Econometrics: A Modern Approach*, South-Western, 4<sup>th</sup> edition, 2009

MADDALA, J. S.. *Introducion to Econometrics*, John Wiley & Son, 3rd edition, 2001

## 10. Minicurrículo do(s) Professor(s)

Possui graduação em Economia pela Fundação Getúlio Vargas (2008), mestrado em Economia pela Fundação Getúlio Vargas (2012) e doutorado em Economia pela Fundação Getúlio Vargas (2017). Foi professor dos cursos de Microeconomia 2 e Econometria 2 da Graduação em Economia da Fundação Getúlio Vargas (2017). Tem experiência na área de Economia, com ênfase em Finanças. Atualmente é pesquisador no Centro de Estudos em Regulação e Infraestrutura (FGV CERI) e professor no Mestrado Profissional em Economia e Finanças da FGV EPGE (2019).

## 11. Link para o Currículo Lattes

<http://lattes.cnpq.br/0270254164350496>