
CURSO: Graduação em Economia – 1º Semestre de 2020
DISCIPLINA: Econometria I
PROFESSOR(ES): Pedro Engel
MONITOR(A): Maria Gabriela
CARGA HORÁRIA: 60h
PRÉ-REQUISITO: Estatística
HORÁRIO E SALA DE ATENDIMENTO: quinta-feira de 14 às 16 hs.
SALA: 201.1 (FGV CER1)

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; Análise de variância e teste de hipótese; Variáveis omitidas e variáveis irrelevantes; O Coeficiente R²; As estatísticas de Wald, LR e LM; Violações das suposições do modelo de regressão linear; Heterocedasticidade; Multicolinearidade; Variáveis Dummy; Método de estimação: o método de variável instrumental; Introdução a Análise com dados em Painel; O modelo de efeitos fixos; O modelo de efeitos aleatórios;

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

Datas	Tópico	Atividades
Aula 1	Análise de Regressão Simples	Cap 2
Aula 2	Análise de Regressão Simples	Cap 2
Aula 3	Análise de Regressão Múltipla	Cap 3
Aula 4	Análise de Regressão Múltipla	Cap 4
Aula 5	Análise de Regressão Múltipla	Cap 4
Aula 6	Teoria Assintótica	Cap 5
Aula 7	Teoria Assintótica	Cap 5
Aula 8	Análise com variáveis dependentes discretas	Cap 7
Aula 9	Análise com variáveis dependentes discretas	Cap 7
Aula 10	Problemas de Heteroscedasticidade	Cap 8
Aula 11	Problemas de Heteroscedasticidade	Cap 8
Aula 12	Outros problemas de especificação	Cap 9
Aula 13	Outros problemas de especificação	Cap 9
Aula 14	Análise de Dados em Painel	Cap 13
Aula 15	Análise de Dados em Painel	Cap 14
Aula 16	Variáveis Instrumentais	Cap 15
Aula 17	Variáveis Instrumentais	Cap 15
Aula 18	Modelos de Equações simultâneas	Cap 16
Aula 19	Modelos de Equações simultâneas	Cap 16
Aula 20	Modelos com Variáveis dependentes limitadas	Cap 17
Aula 21	Modelos com Variáveis dependentes limitadas	Cap 17
Aula 22	Aula no laboratório	LAB
Demais Aulas	Revisão e aulas práticas	Exercícios de Fixação

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, 4th 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>