

---

CURSO: Graduação em Economia – 1º Semestre de 2019

DISCIPLINA: Econometria I

PROFESSOR: Cecília Machado

CARGA HORÁRIA: 60h

PRÉ-REQUISITO: Estatística

HORÁRIO E SALA DE ATENDIMENTO: agendar por e-mail ([cecilia.machado@fgv.br](mailto:cecilia.machado@fgv.br))

SALA: 1014

## PLANO DE ENSINO

### 1. Ementa

Análise de Regressão; O método de mínimos quadrados; Inferência estatística no modelo de regressão linear; Outliers; Regressão Múltipla; Interpretação dos coeficientes de regressão; Correlação parcial e correlação múltipla; Análise de variância e teste de hipótese; Variáveis omitidas e variáveis irrelevantes; O Coeficiente R<sup>2</sup>; As estatísticas de Wald, LR e LM; Violações das suposições do modelo de regressão linear; Heterocedasticidade; Autocorrelação; Multicolinearidade; Variáveis Dummy e variáveis truncadas; Modelos de equações simultâneas; O problema de identificação; Método de estimação: o método de variável instrumental; Introdução a séries de tempo; Séries estacionárias e não estacionárias; Modelos de séries de tempo; ruídos branco; passeio aleatório; processo média móvel ou moving average (MA); processo auto regressivo (AR); processo auto-regressivo com média móvel; processos integrados; Estimação; Abordagem de Box-Jenkins; Introdução à cointegração; Análise com dados em Painel; O modelo de efeitos fixos; O modelo de efeitos aleatórios; O teste de Hausman: efeitos fixos versus efeitos aleatórios; Introdução a modelos de painel dinâmico.

### 2. Objetivos da disciplina

O objetivo do curso é capacitar o aluno para o desenvolvimento de trabalhos empíricos nas áreas de economia e finanças através do uso de software econométrico (STATA ou 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 entender e produzir análises empíricas nas áreas de economia e finanças.

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

Os instrumentos ensinados em sala de aula contribuem para o entendimento e análise de dados econômicos.

#### 5. Procedimentos de ensino (metodologia)

O conteúdo do curso será lecionado em aulas expositivas. Listas de exercícios, com questões teóricas e empíricas sobre o material do curso, serão discutidas nas monitorias.

#### 6. Conteúdo programático detalhado

<b>Datas</b>	<b>Tópico</b>	<b>Atividades</b>
11/Fev/19	Introdução, Revisão e Motivação	Aula Expositiva
13/Fev/19	Modelo de Regressão Linear Simples	Aula Expositiva
18/Fev/19	Modelo de Regressão Linear Simples: Inferência	Aula Expositiva
20/Fev/19	Modelo de Regressão Linear Múltipla	Aula Expositiva
25/Fev/19	Modelo de Regressão Linear Múltipla	Aula Expositiva
27/Fev/19	Teoria Assintótica	Aula Expositiva
11/Mar/19	Teoria Assintótica	Aula Expositiva
13/Mar/19	Modelo de Regressão Múltipla: Inferência	Aula Expositiva
18/Mar/19	Modelo de Regressão Múltipla: Inferência	Aula Expositiva
20/Mar/19	Formas Funcionais da Regressão	Aula Expositiva
25/Mar/19	Formas Funcionais da Regressão	Aula Expositiva
27/Mar/19	Validade Interna e Externa	Aula Expositiva
1/Abr/19	Validade Interna e Externa	Aula Expositiva
3/Abr/19	Endogeneidade e Variável Instrumental	Aula Expositiva
8/Abr/19	Finalização do Conteúdo e Revisão	Aula Expositiva
TBA	Avaliação A1	Avaliação
24/Abr/19	Endogeneidade e Variável Instrumental	Aula Expositiva
29/Abr/19	Endogeneidade e Variável Instrumental	Aula Expositiva
6/Mai/19	Trabalho	Avaliação
8/Mai/19	Modelos de Equações Simultâneas	Aula Expositiva

13/Mai/19	OLS, GMM e Máxima Verossimilhança	Aula Expositiva
15/Mai/19	OLS, GMM e Máxima Verossimilhança	Aula Expositiva
20/Mai/19	Modelos de Escolha Discreta	Aula Expositiva
22/Mai/19	Modelos de Escolha Discreta	Aula Expositiva
27/Mai/19	Dados em Painel	Aula Expositiva
29/Mai/19	Dados em Painel	Aula Expositiva
3/Jun/19	Dados em Painel	Aula Expositiva
5/Jun/19	Dados em Painel	Aula Expositiva
10/Jun/19	Finalização do Conteúdo e Revisão	Aula Expositiva
TBA	Avaliação A2	Avaliação

## 7. Procedimentos de avaliação

A nota final do curso será composta por duas provas (com peso de 45% cada) e um trabalho (10%). O aluno que faltar a qualquer uma das avaliações terá nota zero na respectiva avaliação. Ao final do período, o aluno que não tiver obtido média seis poderá realizar uma avaliação extra que substituirá no cálculo da média final a menor nota das duas primeiras provas.

## 8. Bibliografia Obrigatória

STOCK, James and WATSON, Mark. *Introduction to Econometrics*. Prentice Hall, 3<sup>rd</sup> edition, 2015

WOOLDRIDGE, J. *Introductory Econometrics: A Modern Approach*. Cengage, 6<sup>th</sup> edition, 2016

MADDALA, J. S. and LAHIRI, K. *Introduction to Econometrics*, John Wiley & Son, 4<sup>th</sup> edition, 2009

## 9. Bibliografia Complementar

DAVIDSON, R.; MACKINNON, J.. *Econometric Theory and Methods*. Oxford University Press, 2004.

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

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

KMENTA, J. *Elementos de Econometria*. Atlas, 1980.

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

Possui graduação em Economia pela Universidade Federal do Rio de Janeiro (2002), mestrado em Economia pela Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro (2005) e Doutorado em Economia por Columbia University (2010). Atualmente é research affiliate do Institute for the Study of Labor (IZA) e professora assistente da Fundação Getúlio Vargas - RJ. Tem experiência na área de Economia, com ênfase em Microeconomia Aplicada, Economia do Trabalho e Econometria.

## **11. Link para o Currículo Lattes**

<http://lattes.cnpq.br/9740537725465448>