



Departamento de Economia

ECONOMETRIA I - ECO 1804

Ementa do Curso

2021 - Semestre 1

Dia e horário: 2a/4a. - 9h às 11h
Local: Ensino Remoto (Zoom)
Professor: Nathalie Gimenes
Contato: ngimenes@econ.puc-rio.br
Monitor: Gilberto Boaretto (gilbertoboaretto@hotmail.com)

1. OBJETIVO

Econometria é parte essencial do aprendizado intelectual de um economista. Este curso tem como objetivo ensinar o aluno a analisar e interpretar modelos econômicos de regressão linear bem como proporcionar ferramentas que possibilitem estimar e fazer inferência a respeito desses modelos. Também estuda-se no curso as consequências de violações das hipóteses básicas por trás do modelo de regressão linear e possíveis limitações da análise empírica. Ao término do curso, o aluno será capaz de:

1. Avaliar de forma crítica trabalhos da area de Economia Aplicada.
2. Analisar, interpretar e fazer inferências de dados empíricos.
3. Utilizar pacotes estatísticos como uma ferramenta quantitativa e de análise estatística.
4. Entender as hipóteses por trás dos modelos e limitações dos resultados obtidos.
5. Entender a natureza da incerteza e métodos utilizados para lidar com isso.

2. CRITÉRIOS DE AVALIAÇÃO

A avaliação segue o critério número 3 da PUC-Rio. A avaliação terá como base duas provas (P1 e P2), testes em sala de aula e duas listas práticas. As provas P1 e P2 cobrem, respectivamente, a primeira e a segunda parte do curso e terão peso de 70% na média final. Os testes também serão referentes à primeira (Q1T1-Q3T1) e à segunda (Q4T2 e

Q5T2) parte do curso e terão peso de 15% na média final. Os alunos receberão ao longo do curso **2 (duas) listas de exercícios analíticos** e **2 (duas) listas de exercícios práticos**. Não será cobrada a entrega das **listas analíticas**. As **listas práticas** deverão ser feitas individualmente ou em duplas estabelecidas no início do curso e entregues nas datas apresentadas na Tabela 3. Essas listas práticas terão peso de 15% na média final. Não serão aceitas listas entregues após o prazo. A média dos testes e das listas práticas compõem os graus T1 e T2. A média final será calculada da seguinte forma:

$$M = \frac{G1 + G2}{2}, \text{ onde } G1 = \frac{7 * P1 + 3 * T1}{10} \text{ e } G2 = \frac{7 * P2 + 3 * T2}{10}.$$

Caso o grau G2 do aluno for inferior a 3 (ou seja, $G2 < 3$), então a média será computada da seguinte forma:

$$M = \frac{G1 + 3 * G2}{4}$$

Será aprovado no curso o aluno cuja média M for superior a 6 (seis). Só em casos excepcionais o aluno que faltar à P1 ou à P2 terá direito a uma prova de reposição. **É necessário apresentar justificativa formal.** Não haverá prova final.

Table 1: Calendário de Provas

Avaliação	Data
P1	26/04
P2	23/06

Table 2: Calendário de Testes

	Data
Q1T1	22/03
Q2T1	05/04
Q3T1	19/04
Q4T2	19/05
Q5T2	02/06
Q6T2	21/06

Table 3: Entrega das Listas Práticas

	Data
LP1	12/05
LP2	21/06

3. PROGRAMA

Tópicos	Material
Revisão de Estatística Básica	W (Apêndices A, B, C) e SW (Cap. 2 e 3)
1. Introdução à Econometria; estrutura dos dados econômicos; Noções de Causalidade e <i>ceteris paribus</i>	W (Cap. 1) e SW (Cap. 1)
2. Modelo de Regressão Simples	W (Cap. 2) e SW (Cap. 4)
3. Modelo de Regressão Múltipla	W (Cap. 3) e SW (Cap. 6)
4. Inferência	W (Cap. 4) e SW (Cap. 5 e 7)
5. Forma Funcional	W (Cap. 6) e SW (Cap. 8)
6. Variáveis Binárias	W (Cap. 7) e SW (Cap. 8)
7. Teoria Assintótica	W (Cap. 5)
8. Variáveis proxy e Erros de Medida	W (Cap. 9) e SW (Cap 9.2)
9. Heteroscedasticidade	W (Cap. 8) e SW (Cap. 5.4)
10. Variáveis Instrumentais	(Cap. 15) e SW (Cap. 12)
11. Dados em Painel	W (Cap. 13 e 14) e SW (Cap. 10)
12. Variáveis Dependentes Limitadas	W (Cap. 17) e SW (Cap. 11)

4. BIBLIOGRAFIA

1. **Wooldridge, J. M.** (2010). *Introdução à Econometria: uma abordagem moderna*. 5ª edição. Cengage Learning. (W)
2. **Stock, J.H., and M.M. Watson** (2012) *Introduction to Econometrics*. 3ª edição. Pearson. (SW)
3. **Greene, W.H.** (2000). *Econometric Analysis*. 4ª edição. Prentice Hall.