



ECO 1804 - ECONOMETRIA I - 2021.2

Horário de Aulas: 2^{as} e 4^{as} feiras, de 9:00 às 11:00 horas

Prof. Gustavo Gonzaga - gonzaga@econ.puc-rio.br

Monitores: Fredie Didier (fdidier@terra.com.br) e Igor Rigolon (igor.rilave@hotmail.com)

Horário das Monitorias: 6^{as} feiras, de 15:00 às 17:00 horas

I - OBJETIVOS

Apresentar as técnicas e métodos econométricos básicos, capacitando o aluno a entender, analisar e elaborar trabalhos empíricos na área de economia.

II – EMENTA

O modelo de regressão linear, variáveis binárias, dados em painel, variáveis dependentes limitadas e variáveis instrumentais.

III – BIBLIOGRAFIA

* WOOLDRIDGE, J.M. (2017): Introdução à Econometria: Uma abordagem moderna, 6a Ed., Editora Thomson Learning.

STOCK, J.H. e M.W. WATSON (2004): Econometria, Addison-Wesley (opcional).

IV - PROGRAMA DO CURSO

Tópico	Referência	
	Wooldridge	Stock-Watson
1 – Introdução e regressão linear simples	Caps. 1 e 2	Caps. 1 e 4
2 – Regressão linear múltipla	Cap. 3	Cap. 5 e 6
3 – Inferência em regressão linear múltipla	Cap. 4	Caps. 4, 5 e 6
4 – Variáveis Binárias (Variáveis <i>Dummy</i>)	Cap.7, exceto 7.5	Cap. 4.7
5 – Tópicos adicionais em regressão múltipla	Caps. 5.1 e 6.1-6.3	Cap. 6
6 – Heteroscedasticidade	Cap. 8.1-8.2 e 8.4	Caps. 4.9 e 15.6
7 – Dados em Painel	Caps. 13 e 14.1	Caps. 8 e 11
8 – Variáveis Proxy e erros de medida	Cap. 9.2 e 9.4	Cap. 7.2
9 – Variáveis Instrumentais	Caps. 15 e 16	Cap. 10
10 – Variáveis Dependentes Limitadas	Caps. 7.5, 17.1-17.2 e 17.4	Cap. 9

V – AVALIAÇÃO

A avaliação segue o critério 7 da PUC-Rio. A avaliação terá como base duas provas (P_1 e P_2), três testes (T_1 , $T_{2.1}$ e $T_{2.2}$) e cinco listas práticas ($LP_{1.1}$, $LP_{1.2}$, LP_2 , LP_3 e LP_4). As provas P_1 e P_2 valem 7 pontos cada. O teste T_1 vale 1 ponto e os testes $T_{2.1}$ e $T_{2.2}$ valem 0,5 ponto cada. As listas práticas $LP_{1.1}$ e $LP_{1.2}$ valem 0,5 ponto cada e as listas práticas LP_2 , LP_3 e LP_4 valem 1 ponto cada. A nota N_1 é calculada da seguinte forma:

$$N_1 = (G_1 + G_2)/2, \text{ onde } G_1 = (P_1 + T_1 + LP_{1.1} + LP_{1.2} + LP_2) \text{ e } G_2 = (P_2 + T_{2.1} + T_{2.2} + LP_3 + LP_4)$$

Será aprovado no curso o aluno cuja nota N_1 for superior a 6 (seis). Em caso de média inferior a 6 (seis), ou de um dos dois graus (G_1 ou G_2) inferior a 3 (três), o aluno deverá fazer a prova final (PF) que envolve toda a matéria do curso. Para ser aprovado, então, o aluno deverá ter pelo menos média igual a 5 (cinco). Não é permitido ao aluno fazer a PF para aumentar a nota.

$$N_{\text{Final}} = (N_1 + \text{PF})/2 \geq 5$$

Só em casos excepcionais os alunos que faltarem à P_1 ou à P_2 terão direito a usar a PF também como prova de reposição. Nesse caso, os alunos deverão fazer a PF, cuja nota será usada para calcular o grau incompleto. Não há uma segunda chamada para a PF.

Datas e tópicos das provas

	Data	Tópicos
Prova 1 (P_1)	29/9	1-5
Prova 2 (P_2)	3/12	6-10
Prova Final (PF)	13/12	Todos

Os alunos receberão 2 **listas de exercícios analíticos** e 4 **listas de exercícios práticos**. Não será cobrada a entrega das **listas analíticas**, que são úteis para estudar para as provas. As **listas práticas** devem ser feitas individualmente ou em duplas estabelecidas no início do curso. Não serão aceitas listas entregues após o prazo. Também não serão aceitas listas de grupos com mais de 2 alunos.

Datas de entrega das listas práticas

	Data
Lista Prática 1.1 ($LP_{1.1}$)	30/8
Lista Prática 1.2 ($LP_{1.2}$)	8/9
Lista Prática 2 (LP_2)	22/9
Lista Prática 3 (LP_3)	25/10
Lista Prática 4 (LP_4)	24/11

As datas dos testes serão divulgadas posteriormente. As notas em cada lista serão determinadas de acordo com os níveis abaixo (com nota máxima igual a 0,5 nas listas $LP_{1.1}$ e $LP_{1.2}$):

Lista Prática
1
0,75
0,5
0,25
0

Programas econométricos recomendados

R: software gratuito disponível em <https://cran.fiocruz.br/> e também deve-se baixar a interface RStudio disponível em <https://www.rstudio.com/products/rstudio/download/#download>

Gretl: software gratuito disponível em <http://gretl.sourceforge.net> (versão para Windows em <http://gretl.sourceforge.net/win32/>). As bases de dados completas de Wooldridge (2010) e Stock e Watson (2004) para uso com o Gretl também estão disponíveis em <http://gretl.sourceforge.net/win32/>.

Outro programa recomendado (não-gratuito) é o **Stata**.