



ECO

ECO1442 – Econometria I

CARGA HORÁRIA TOTAL: 90 horas

CRÉDITOS: 6

PRÉ-REQUISITO(S):

ECO1441/MAT1343

ECO1441/MAT1260

ECO1721 / MAT1260

ECO1721/MAT1343

HORÁRIO DAS AULAS:

2ª e 4ª de 09h às 11h e 6ª de 13h às 15h (online)

PROFESSORES:

Nathalie Gimenes (ngimenes@econ.puc-rio.br)

Gilberto Boaretto (gilbertoboaretto@hotmail.com)

MONITORES:

Guilherme Campanha (guipacampanha@outlook.com)

Andre Alvarenga (andre.alvquim@gmail.com)

OBJETIVOS

Econometria é parte essencial do aprendizado intelectual de um economista. Este curso tem como objetivo apresentar as ferramentas básicas de estatística utilizadas para analisar e interpretar modelos econômicos e aplicações empíricas. O curso se inicia com o estudo do modelo de regressão linear e técnicas de inferência. Posteriormente, estuda-se as consequências de violações das hipóteses básicas por trás do modelo de regressão linear e possíveis limitações da análise empírica.

EMENTA

Introdução ao estudo da Econometria: estrutura dos dados econômicos, noções de causalidade e ceteris paribus; modelo de regressão linear simples; modelo de regressão linear múltipla; inferência; forma funcional; variáveis



binárias; teoria assintótica; variáveis proxy e erros de medida; heteroscedasticidade; variáveis instrumentais; dados em painel; variáveis dependentes limitadas.

PROGRAMA

(As datas estabelecidas abaixo poderão sofrer alterações no decorrer do curso.)

Aulas	Tópicos	Material
04/03	Apresentação do curso	
06/03	Revisão de prob e estatística	
11/03	Introdução ao estudo da Econometria: estrutura dos dados econômicos, noções de causalidade e ceteris paribus;	W (Cap. 1) e SW (Cap. 1)
13/03 à 25/03	Modelo de regressão linear simples	W (Cap. 2) e SW (Cap. 4)
27/03 à 03/04	Modelo de regressão linear múltipla	W (Cap. 3) e SW (Cap. 6 e 8),
08/04 e 10/4	Inferência e testes de hipóteses	W (Cap. 4) e SW (Cap. 5 e 7)
15/4 e 17/04	Variáveis binárias	W (Cap. 7) e SW (Cap. 8)
06/05	Prova 1	
29/04	Teoria assintótica	W (Cap. 5)
06/05	Vista de Prova	
08/05	Variáveis proxy e erros de medida	W (Cap. 9) e SW (Cap 9.2)
13/05 e 15/05	Heteroscedasticidade e mínimos quadrados generalizados	W (Cap. 8) e SW (Cap. 5.4)
20/05 à 27/05	Variáveis instrumentais	W (Cap. 15) e SW (Cap. 12)
29/05 à 05/06	Dados em painel	W (Cap. 13 e 14) e SW (Cap. 10)
10/06 à 17/06	Variáveis dependentes limitadas	W (Cap. 17) e SW (Cap. 11)
24/06	Prova 2	
01/07	Vista de Prova	
03/07	G3	

AVALIAÇÃO

A avaliação segue o critério número 7 da PUC-Rio. A nota N1 é calculada da seguinte forma: $N1 = (G1 + G2)/2$.

Será aprovado no curso o aluno cuja nota N1 for superior a 6 (seis). Em caso de média inferior a 6 (seis), ou de um dos dois graus (G1 ou G2) 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.**

$$N_{Final} = (N1 + PF)/2 \geq 5$$

Os graus 1 e 2 (G1 e G2) serão médias ponderadas das partes teórica e prática do curso. As avaliações da parte teórica do curso (duas provas - P1 e P2 - e quatro testes analíticos - T1, T2, T3 e T4) terão peso de dois terços (2/3) de cada grau, enquanto a média simples de seis listas práticas (LP1, LP2, LP3, LP4, LP5 e LP6) terá peso de um terço (1/3).

$$G1 = 2/3*(P1+T1+T2) + 1/3*(LP1+LP2+LP3) \text{ e } G2 = 2/3*(P2+T3+T4) + 1/3*(LP4+LP5+ LP6)$$



Só em casos excepcionais o aluno que faltar à P1 ou à P2 terá direito a usar a PF também como prova de reposição. Nesse caso, o aluno deverá fazer a PF, cuja nota será usada para calcular o grau incompleto. O aluno deverá dar entrada ao pedido de segunda chamada via requerimento acadêmico pelo endereço www.ccpa.puc-rio.br/sap no prazo de **até 7 dias depois da data da avaliação**. Não há uma segunda chamada para a PF.

Calendário de Provas

Avaliação	Data
P1	06/05
P2	24/06
PF	03/07

Os alunos receberão 2 listas de exercícios analíticos e 6 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 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.

Calendário de Testes (Quizzes)

Avaliação	Data
T1	03/04
T2	17/04
T3	27/05
T4	17/06

As datas das listas práticas serão divulgadas posteriormente.

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>

BIBLIOGRAFIA PRINCIPAL

Wooldridge, J. M. (2010). *Introdução à Econometria: uma abordagem moderna*. 5ª edição. Cengage Learning. (W)

Stock, J.H., and M.M. Watson (2012) *Introduction to Econometrics*. 3ª edição. Pearson. (SW)

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

Greene, W.H. (2000). *Econometric Analysis*. 4ª edição. Prentice Hall.