

ECO 1442 - ECONOMETRIA I - 2025.2

Horário de Aulas: 2ª e 4ª feira, de 9:00 às 11:00 horas, e 6ª feira, de 13:00 às 15:00 horas (online)

Profs. Gustavo Gonzaga (gonzaga@econ.puc-rio.br), Lucas Lima (lucas.lima@econ.puc-rio.br) e Gilberto Boaretto (gboaretto@puc-rio.br)

Monitor: Philippe Bernardes Lebailly (phlebailly6@gmail.com)

Horário das Monitorias: a combinar

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 a – BIBLIOGRAFIA BÁSICA

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

STOCK, J.H. e M.W. WATSON (2017): Econometria, Addison-Wesley (opcional).

HANCK, C.; GERBER, A. e SCHMELZER, M.: Introduction to Econometrics with R.
Disponível em: <https://www.econometrics-with-r.org/ITER.pdf>

III b – BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

* WICKMAN, H. e GROLEMUND, G. (2019): R para Data Science, 1a Ed., Editora Alta Books.

GUJARATI, D. e PORTER, D. (2011): Econometria Básica, 5a Ed., Editora AMGH.

ANGRIST, J. e PISCHKE, J-S. (2014): Mastering 'Metrics: The Path from Cause to Effect, Princeton University Press.

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 – Variáveis Proxy e erros de medida	Cap. 9.2 e 9.4	Cap. 7.2
7 – Heteroscedasticidade	Cap. 8.1-8.2 e 8.4	Caps. 4.9 e 15.6
8 – Dados em Pannel	Caps. 13 e 14.1	Caps. 8 e 11
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 – Fraudes em avaliações

Este curso adotará as seguintes medidas contra fraude em avaliações:

1. Cola em prova implicará nota 0 **no grau**, e não apenas na prova. O mesmo critério também se aplica a quem passar cola.
2. Plágio em trabalhos também implicará nota 0 **no grau**, e não apenas no trabalho.
3. Celular, smartwatch ou outros eletrônicos não autorizados durante as provas que estejam ao alcance das mãos (bolso da roupa, sob a perna, no chão etc.) implicarão nota 0 **no grau**, e não apenas na prova.
4. Cola e plágio eliminam a possibilidade de segunda chamada na avaliação em questão.
5. Em caso de reincidência, haverá reprovação na disciplina.
6. Todos os casos serão reportados para a Coordenação do curso, que poderá adotar medidas adicionais, como solicitar suspensão ou jubramento do aluno.
7. Veja mais informações no Compromisso de Ética do Departamento, disponível no link a seguir: <https://www.econ.puc-rio.br/areadoalunoimgs/compromissodeetica17Mai21.pdf> Este documento também deverá estar disponível na página do curso no moodle.

VI – AVALIAÇÃO

A avaliação segue o critério 7 da PUC-Rio. A nota N_1 é calculada da seguinte forma: $N_1 = (G_1 + G_2)/2$

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.

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

Os graus 1 e 2 (G_1 e G_2) serão médias ponderadas das partes teórica e prática do curso. As avaliações da parte teórica do curso compõem três quartos (3/4) de cada grau, enquanto as avaliações práticas do laboratório (AP_1 e AP_2) terão peso de um quarto (1/4). Na parte teórica, no Grau 1, uma prova (P_1) terá peso de 90% e atividades em sala de aula (como testes analíticos e Kahoots), A_1 , terão peso de 10%. No Grau 2, a prova (P_2) terá peso de 85%, as atividades em sala de aula (como testes analíticos e Kahoots), A_2 , terão peso de 10% e um trabalho de extensão (cujas instruções serão enviadas mais tarde), E_2 , terá peso de 5%. Atividades desenvolvidas na monitoria valerão um bônus (B_1 e B_2) de até 0,5 ponto em cada um dos graus.

$$G_1 = \frac{3}{4}*(0,9*P_1+0,1*A_1+B_1) + \frac{1}{4}*(AP_1) \text{ e } G_2 = \frac{3}{4}*(0,85*P_2+0,1*A_2+0,05*E_2+B_2) + \frac{1}{4}*(AP_2)$$

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)	8/10	1-6
Prova 2 (P_2)	1/12	7-10
Prova Final (PF)	10/12	Todos

As provas práticas serão marcadas pelo prof. Gilberto Boaretto. Os alunos receberão 2 **listas de exercícios analíticos** e 5 **listas de exercícios práticos**. Não será cobrada a entrega das **listas**, mas recomenda-se que os alunos resolvam os exercícios, que são úteis para estudar para as provas e atividades do curso.

VII - 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**.