

Disciplina: Econometria	Créditos: 4
Curso: Mestrado em Economia	Unidade: FACE
Semestre: 2022/01	Calendário, Horários e Modalidade Período 1: 30/03 a 29/04 – Quartas e Sextas: 18:30h – 20:20h – Remota Sala virtual: https://cutt.ly/monsueto Período 2: 23/05 a 29/07 – Dias e horários a definir – Previsto para ser presencial nas dependências de FACE/UFG.
Professor: Sandro Eduardo Monsueto	
Contato: FACE – sala 1211 – Telefone: 3521-1390 – e-mail: monsueto@ufg.br	

1. EMENTA:

Modelo de regressão linear clássico. Diagnóstico e análise dos pressupostos do modelo clássico. Multicolinearidade. Heterocedasticidade. Autocorrelação. Modelos de equações simultâneas. Estimadores de Mínimos Quadrados de dois (2SLS) e três (3SLS) estágios; Introdução a modelos de regressão com dados em painel. Modelos com variáveis defasadas; Introdução à análise de séries temporais.

2. OBJETIVOS:

Fornecer o instrumental teórico fundamental para análise de regressão em economia aplicada. Acostumar o aluno com as demonstrações algébricas típicas dos artigos da área. Fornecer bases de escolha, estimativa, avaliação e interpretação dos modelos econométricos.

3. CONTEÚDO PREVISTO

UNIDADE 1 – INTRODUÇÃO

- Conceitos básicos
- O modelo econométrico

UNIDADE 2 – O MODELO DE REGRESSÃO CLÁSSICO

- Estimação por OLS
- Hipóteses e propriedades
- Inferência e teste de hipóteses
- Variáveis binárias

UNIDADE 3 – PROBLEMAS CLÁSSICOS

- Multicolineariedade
- Heterocedasticidade
- Autocorrelação residual

UNIDADE 4 – INTRODUÇÃO AOS MODELOS DE SÉRIES TEMPORAIS

- Modelos ARMA
- Processos de Raiz Unitária
- Cointegração

UNIDADE 5 – ENDOGENEIDADE, SIMULTANEIDADE E PAINEL

- Endogeneidade e variáveis instrumentais
- Modelos de dados em painel

UNIDADE 6 – ESTIMADORES

- Estimadores paramétricos e semi-paramétricos
- Modelos não lineares
- Estimador de máxima verossimilhança

4. CRONOGRAMA PREVISTO

A previsão é que as Unidades 1 e 2 sejam feitas na modalidade remota (sala virtual informada no cabeçalho). As demais unidades estão previstas para ocorrer de forma presencial. A parte remota será entre os dias 28/03 e 29/04. Após o recesso, as aulas retornam de forma presencial nas dependências da FACE a partir do dia 23/05 até 29/07. Podem ocorrer mudanças no cronograma no decorrer do semestre. Também estão previstas atividades assíncronas de realização de avaliações. A modalidade de aulas, se remota ou presencial, depende de regulamentação da universidade e pode ser alterada ao longo do semestre.

5. CRITÉRIOS DE AVALIAÇÃO

A avaliação será composta por duas provas individuais (P1, P2) e por um trabalho prático, também individual (T). A Média Final (MF) será dada pela fórmula:

$$MF = P1 * (0,25) + P2 * (0,25) + T * (0,50)$$

O trabalho está previsto para ser realizado em etapas. Sua nota final (T) é a média das notas de cada etapa. O aluno será considerado aprovado se obtiver **MF ≥ 5,0**, conforme Quadro abaixo, e no mínimo **85% de presença** da carga horária total da disciplina. **Não serão tiradas dúvidas por e-mail ou por telefone**. O professor não tirará dúvidas em dia de prova ou em dia de entrega do trabalho. Informações adicionais podem ser encontradas no Regulamento do Programa.

Conceito	Nota
A – Aprovado Muito Bom	MF ≥ 9
B – Aprovado Bom	7 > MF < 9
C – Aprovado Regular	5 ≥ MF ≤ 7
D – Reprovado sem direito à crédito	MF < 5

6. BIBLIOGRAFIA

- [BA] BALTAGI, B.H. (2003): A companion to theoretical econometrics. Blackwell Publishing.
- [BF] BAUM, C. F. (2006): An introduction to modern econometrics using Stata. Stata Press.
- [BR] BUENO, R. L. S. (2011): Econometria de Séries Temporais. São Paulo: Cengage Learning, 2^ªed.
- [EN] ENDERS, W. (2014): Applied econometric time series. New York: John Wiley & Sons, INC., 2^ªed.
- [GP] GUJARATI, D.N. e PORTER, D.C. (2011): Econometria básica. São Paulo: Mc Grall Hill, 5^ªed.
- [GR] GREENE, W. (2012): Econometric analysis, Prentice Hall. 7^ªed.
- [HY] HAYASHI, F. (2000): Econometrics. Princeton University Press.
- [MS] MANTOVANI, G.G.; SOUZA, S.C.I.; GOMES, M.R. (2021): Diferenças salariais e intraocupações: evidências para o Paraná e Bahia. Gestão & Regionalidade, v.37, n.110. pp. 94-116.
- [CS] CUNHA, J.; SOUZA, J.; FERREIRA, F.; COSTA, F.; NÓBREGA, J. (2022): Retornos salariais da educação no Rio Grande do Norte: evidências recentes. Revista da ABET. v.20, n.2. pp.518-535.
- [SB] SIMON, C. e BLUME, L. (2004): Matemática para economistas. Porto Alegre: Bookman.

O [GR] é o livro texto principal. Textos/Artigos adicionais serão acrescentados ao longo do semestre.