



MINISTÉRIO DA EDUCAÇÃO  
UNIVERSIDADE FEDERAL DE GOIÁS  
FACULDADE DE ADMINISTRAÇÃO, CIÊNCIAS CONTÁBEIS E CIÊNCIAS  
ECONÔMICAS  
PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA - PPE  
PLANO DE ENSINO



<b>Disciplina:</b> Econometria		<b>Créditos:</b> 4
<b>Curso:</b> Mestrado em Economia		<b>Unidade:</b> FACE
<b>Semestre:</b> 2019/2	Segunda-Feira (16:00h – 17:50h) e Quarta-Feira (16:00h – 17:50h)	
<b>Professor:</b> Sandro Eduardo Monsueto		
<b>Contato:</b> <a href="mailto:monsueto@ufg.br">monsueto@ufg.br</a>		

#### 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, estimação, 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

- Multicolinearidade
- Heterocedasticidade
- Autocorrelação residual

##### UNIDADE 4 – TÓPICOS ESPECIAIS

- Endogeneidade e variáveis instrumentais
- Modelos de dados em painel
- Equações Simultâneas

##### UNIDADE 5 – ESTIMADORES

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

#### 4. CRITÉRIOS DE AVALIAÇÃO

A avaliação será composta por duas **provas individuais e sem consulta** (P1, P2) e por um trabalho prático, também individual (T1). A Média Final (MF) será dada pela fórmula:

$$MF = [Maior\ Nota(P1, P2) * 0,35] + [Menor\ Nota(P1, P2) * 0,30] + [T * 0,35]$$

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 email 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 $\geq$ 9
B – Aprovado Bom	7 > MF < 9
C – Aprovado Regular	5 $\geq$ MF $\leq$ 7
D – Reprovado sem direito à crédito	MF < 5

## 5. 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.
- [EN] ENDERS, W. (1995): Applied econometric time series. New York: John Wiley & Sons, INC.
- [GP] GUJARATI, D.N. e PORTER, D.C. (2011): Econometria básica. São Paulo: Mc Grall Hill, 5ªed.
- [GR] GREENE, W. (2012): Econometric analysis, Prentice Hall. 7ªed.
- [HY] HAYASHI, F. (2000): Econometrics. Princeton University Press.
- [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.

---

Professor Sandro Eduardo Monsueto  
SIAPE: 1698093