



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



Disciplina: Econometria		Créditos: 4
Curso: Mestrado em Economia		Unidade: FACE
Semestre: 2019/2	Segunda-Feira (16:00h – 17:50h) e Quarta-Feira (16:00h – 17:50h)	
Professor: Sandro Eduardo Monsueto		
Contato: 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, 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