



# Econometria

Professores: **Hedibert Freitas Lopes (4ECO)**

Priscila Fernandes Ribeiro (4ADM-A)

Sérgio Ricardo Martins (4ADM-B)

1º semestre de 2014

# Econometria

## Professor:

**Hedibert Lopes** ([hedibertFL@insper.edu.br](mailto:hedibertFL@insper.edu.br)) – sala 607

[www.hedibert.org](http://www.hedibert.org)

## Horário das aulas:

**4ECO: Quarta-feira das 7h30min às 9h30min**

**Sexta-feira das 7h30min às 9h30min**

## Horários de Atendimento:

**4ECO: Quarta-feira das 9h45min às 11h15min**

**4ADM-A: Quarta-feira das 18h00min às 19h30min**

**4ADM-B: Quinta-feira das 14h00min às 15h30min**

# Econometria

## Monitores:

Gustavo Amarante (4ECO e 4ADM-A)

João Marcos Nusdeo (4ADM-B)

Email: [gusamarante@gmail.com](mailto:gusamarante@gmail.com)

## Horários:

**4ECO: Sexta-feira das 10h00min às 11h30min**

4ADM-A: Sexta-feira das 8h00min às 9h30min

4ADM-B: Sexta-feira das 12h00min às 13h30min

# Objetivo da Disciplina

O objetivo desta disciplina é apresentar uma abordagem introdutória a Econometria dando ênfase tanto à base estatística quanto a aplicações econômicas. Será discutido, em detalhes, o significado e as implicações das suposições do modelo linear geral. Ainda, serão descritos e aplicados testes de violações das hipóteses do modelo linear geral, bem como serão apresentados e aplicados estimadores alternativos ao de mínimos quadrados ordinários (MQO). Ao final desse curso, o aluno deverá ser capaz de utilizar técnicas estatísticas adequadas para mensurar quantidades de interesse e realizar previsões.

# Programa do Curso

## Parte I – Análise de Regressão Linear Simples

### a. Introdução

(O Modelo de Regressão Linear Simples)

### a. Método de Estimação

(Mínimos Quadrados Ordinários)

### d. Medida de Qualidade de Ajuste

### e. Formas Funcionais

### f. Suposições

### g. Propriedade dos Estimadores

### h. Inferência

# Programa do Curso

## Parte II – Modelo Linear Geral (MLG)

- a. Introdução
- b. Modelo
- c. Estimação
- d. Suposições
- e. Propriedades dos Estimadores
- f. Inferência
- g. MLG com Informação Qualitativa
- h. Teoria Assintótica
- i. Heterocedasticidade
- j. Erros de Especificação na Forma Funcional (teste RESET)

# Programa do Curso

## Parte III – Endogeneidade

- a. Definição de endogeneidade
- b. Variáveis Instrumentais
- c. Modelo de Equações Simultâneas
- d. Mínimos Quadrados Indiretos (MQI)
- e. Mínimos Quadrados em 2 Estágios (2SLS)
- f. Teste de Hausman e Teste de Sargan

## Bibliografia Básica

- [1] GUJARATI, D. N. e PORTER, D. C. *Econometria Básica*. 5 ed. Porto Alegre: AMGH Editora Ltda, 2011.
- [2] HEIJ, C.; BOER, P.; FRANSES, P. H.; KLOEK, T. e VAN DIJK, H. K. (2004). *Econometric methods with applications in business and economics*. New York: Oxford University Press.
- [3] WOOLDRIDGE, J. M. *Introdução à Econometria: uma abordagem moderna*. 4. ed. São Paulo: Cengage Learning, 2011.

## Bibliografia Complementar

- [1] STOCK, J. H. e WATSON, M. W. (2003). *Introduction to Econometrics*. Boston: Addison Wesley.



## **Bibliografia Extra-Complementar**

- [1] HILL, C., GRIFFITHS, W. e JUDGE, G. (2003). *Econometria*. 2. ed. São Paulo: Editora Saraiva.
- [2] JOHNSTON, J. and DINARDO, J. (1997). *Econometric Methods*. New York: McGraw-Hill.
- [3] MATSUMOTO, É. Y. (2002). *MATLAB 6.5: fundamentos de programação*. São Paulo: Érica.
- [4] NETER, J., KUTNER, M. H., NACHTSHEIM, C. J. and WASSERMAN, W. (1996). *Applied Linear Statistical Models*. 4. ed. WCB/McGraw Hill.
- [5] PINDYCK, R. S. and RUBINFELD, D. L. (1998). *Econometric Models and Economics Forecasts*. 4. ed. Irwin-McGraw-Hill.
- [6] TAMHANE, A. C. and DUNLOP, D. D. (2000). *Statistics and Data Analysis – from Elementary to Intermediate*. New Jersey: Prentice – Hall.

# Critério de Avaliação

## Provas:

**PI (30%)**

**PF (50%)**

## Análise e Resolução de Problemas (ARP):

**Será feito em grupo, fora da sala de aula, e valerá 5% da nota final.**

# Critério de Avaliação

## Trabalho Final (TF):

- Feito em grupo (4 a 6 integrantes), com formação livre, devendo envolver apenas alunos da própria turma.
- O tema do trabalho final, neste semestre, será livre.
- Este trabalho será dividido em algumas etapas e a nota TF será calculada com base na média de todas as etapas e corresponderá a 15% da nota final.

# Critério de Avaliação

## Trabalho Final (TF): (cont.)

- Entrega do Tema e Justificativa

**Data: 26/02: peso 1**

- Revisão da Literatura

**Data: 14/03: peso 2**

- Relatório Parcial (Análise Descritiva)

**Data: 23/04: peso 3**

- Relatório Final

**Data: 21/05: peso 5**

# Listas de Exercícios

Ao longo do semestre serão distribuídas algumas listas de exercícios e nelas existirão grupos de exercícios que:

- i. serão resolvidos pelo monitor, nas sessões de monitoria;
- ii. poderão ser resolvidos pelos alunos, durante as sessões de monitoria;

**Observação:** A entrega das listas resolvidas não é obrigatória e não vale nota. Todavia, alunos com nota final entre 4,75 e 4,99 terão direito a entrar no critério de arredondamento, caso tenham realizado a entrega de 75% das listas de exercícios.

# Avisos Gerais

Matéria do curso: compreende a matéria dada em sala de aula e a apresentada nas indicações de leitura.

Softwares: serão utilizados os softwares *Eviews*, *MATLAB* e *Stata*.

# Avisos Gerais

## Provas

- será permitido o uso de uma folha de papel sulfite A<sub>4</sub> (frente e verso), como consulta na PI, contendo fórmulas e partes escritas, a critério do aluno.
- será permitido o uso de uma folha de papel sulfite A<sub>4</sub> (frente e verso), como consulta na PF, contendo fórmulas e partes escritas, a critério do aluno.

Observação: folha de consulta deverá ser feita a MÃO e poderá ser recolhida no final da prova para averiguação.

# Regras de Convivência na Sala de Aula

- Os alunos devem chegar no início da aula, obrigatoriamente **portando o prisma**.
- **Caso você encontre a porta da sala fechada, o seu ingresso na aula só poderá ocorrer no momento em que o professor abrir a porta.**
- Durante a aula os celulares devem permanecer desligados. Se o celular tocar, o aluno deverá sair da sala e não poderá mais voltar.



# Regras de Convivência na Sala de Aula

(cont.)

- Qualquer dúvida, pergunte ao professor.
- Se você não tem nenhuma dúvida e nenhum comentário a fazer, **não converse**.
- Os alunos só podem conversar com o professor. Ou, entre si quando estiverem discutindo a matéria em conjunto com o professor.
- Se o aluno conversar indevidamente, ele será convidado a se retirar da sala e seu nome será levado à coordenação.