



UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA
Instituto de Economia e Relações Internacionais
 Av. João Naves de Ávila, nº 2121, Bloco 1J - Bairro Santa Mônica, Uberlândia-MG, CEP 38400-902
 Telefone: (34) 3239-4327 - <http://www.ie.ufu.br/> - ie@ufu.br



PLANO DE ENSINO

1. IDENTIFICAÇÃO

Componente Curricular:	Econometria									
Unidade Ofertante:	IERI									
Código:	IEUFU41051		Período/Série:		5o		Turma:		N	
Carga Horária:							Natureza:			
Teórica:	60	Prática:	00	Total:	60	Obrigatória: (x)		Optativa: ()		
Professor(A):	Flavio Vilela Vieira					Ano/Semestre:		2022-1		
Observações:	Email: flaviovieira@ufu.br									

2. EMENTA

Análise de regressão com dados de séries temporais. Agrupamento de cortes transversais ao longo do tempo: métodos simples de dados de painel. Métodos avançados de dados de painel. Estimação de variáveis instrumentais e mínimos quadrados de dois estágios. Modelos de equações simultâneas. Modelos com variáveis dependentes limitadas e correções da seleção amostral.

3. JUSTIFICATIVA

A importância do curso de Econometria está não apenas em ampliar o conhecimento inicial do aluno após a realização dos cursos de Estatística e introdução à econometria, mas também em detalhar diversos métodos aplicados a séries de tempo e análise de painel além de introduzir métodos como mínimos quadrados em dois estágios, GMM, Probit e Logit, ARCH-GARCH, VAR e VEC (cointegração), testes de estacionariedade das séries de tempo, dentre outros. Ao final do curso o aluno deve ser capaz de aplicar uma série de métodos econométricos cujas aplicações são as mais diversas na área de economia.

4. OBJETIVO

Objetivo Geral:

O presente curso de econometria tem por objetivo introduzir aos alunos alguns conceitos, modelos, métodos econométricos, testes e aplicações econométricas no intuito de complementar a formação inicial já adquirida no curso de econometria 1. A análise TEÓRICA e suas aplicações envolvem os seguintes tópicos: testes de autocorrelação, testes de especificação dos modelos, regressão espúria e teste de estacionariedade das séries temporais, modelos de vetores autoregressivos (var), modelos de Vetores de Correção de Erros (VEC), análise de cointegração (Engle e Granger 2-step e método de Johansen), modelos ARCH-GARCH, variáveis instrumentais e mínimos quadrados em dois estágios (MQ2E), Método dos momentos generalizados (GMM) para séries de tempo, modelos Probit e Logit, e a estimação de modelos de dados em painel (efeito fixo e aleatório) com o teste de Hausman.

Objetivos Específicos:

Familiarizar o aluno com a utilização de softwares econométricos como Eviews e Stata com diferentes aplicações e modelos.

5. PROGRAMA

Período: de 26 de Setembro de 2022 a 06 de Fevereiro de 2023

ATIVIDADES / AULAS**Aula 1 (27 de setembro)**

Apresentação do Programa

Aula 2 (30 de setembro)

Importação de dados do excel para o eviews e revisão mqo

Aula 3 (4 de outubro)

1 - revisão de heterocedasticidade – gujarati cap. 11 *

notas de aula do professor

Aula 4 (7 de outubro)

2 - REVISÃO DE ESPECIFICAÇÃO DE MODELOS – GUJARATI CAP. 13 *

NOTAS DE AULA DO PROFESSOR

Aula 5 (11 de OUTUBRO)

3 - AUTOCORRELAÇÃO

GUJARATI CAP. 12 *

WOOLDRIDGE CAP. 12 *

Aula 6 (14 de OUTUBRO)

4 - ANÁLISE DE REGRESSÃO BÁSICA COM DADOS DE SÉRIES TEMPORAIS: MODELOS ESTÁTICOS E MODELOS DE DEFASAGENS DISTRIBUÍDAS

WOOLDRIDGE, CAP. 10 *

Aula 7 (18 DE OUTUBRO)

5 - USO DE MÍNIMOS QUADRADOS COM DADOS DE SÉRIES TEMPORAIS: QUESTÕES ADICIONAIS

WOOLDRIDGE, CAP. 11 *

Aula 8 (21 DE OUTUBRO)

6 - ECONOMETRIA DE SÉRIES TEMPORAIS: ORDEM DE INTEGRAÇÃO, REGRESSÃO ESPÚRIA E TESTES DE ESTACIONARIEDADE (TESTES ADF, PP, E KPSS)

GUJARATI, CAP. 21 *

WOOLDRIDGE, CAP. 18, SEÇÃO 18.2 E 18.3 *

BUENO, CAP. 4 **

Aula 9 (25 DE OUTUBRO)

CONTINUAÇÃO DE ECONOMETRIA DE SÉRIES TEMPORAIS: ORDEM DE INTEGRAÇÃO, REGRESSÃO ESPÚRIA E TESTES DE ESTACIONARIEDADE (TESTES ADF, PP, E KPSS)

GUJARATI, CAP. 21 *

WOOLDRIDGE, CAP. 18, SEÇÃO 18.2 E 18.3 *

BUENO, CAP. 4 **

Aula 10 (01 de novembro)

revisão prova parcial

Aula 11 (4 DE NOVEMBRO)**PROVA PARCIAL****Aula 12 (08 DE NOVEMBRO)****7 - MODELO DE VETORES AUTO-REGRESSIVOS (VAR) E SEUS INSTRUMENTOS (ADV E FIR)**

NOTAS DE AULA – FLÁVIO VIEIRA E BUENO, CAP. 6 *

GUJARATI, CAP. 22, SEÇÃO 22.9 **

Aula 13 (11 DE NOVEMBRO)**8 - MODELO DE VETOR DE CORREÇÃO DE ERROS (VEC) E ANÁLISE DE COINTEGRAÇÃO (JOHANSEN)**

Notas de aula – flávio vieira

WOOLDRIDGE, CAP. 18, SEÇÃO 18.4 *

Aula 14 (18 DE NOVEMBRO)**9 - MÉTODO DOS MOMENTOS GENERALIZADOS (GMM) PARA SÉRIES DE TEMPO**

NOTAS DE AULA – FLÁVIO VIEIRA – Resumo do Artigo de WOOLDRIDGE (2001)

Aula 15 (22 DE NOVEMBRO)**10 MODELOS NÃO-LINEARES (ARCH-GARCH) E TESTE DE DETECÇÃO DE ARCH (ENGLE)**

MORETTIN E TOLOI, CAP. 12, SEÇÕES 12.3 E 12.4 *

Aula 16 (25 DE NOVEMBRO)**11 ANÁLISE DE DADOS EM PAINEL: EFEITOS FIXOS, EFEITOS ALEATÓRIOS E TESTE DE HAUSMAN**

WOOLDRIDGE, CAP. 14 *

Aula 17 (29 DE NOVEMBRO)**12 VARIÁVEIS INSTRUMENTAIS E MÍNIMOS QUADRADOS EM DOIS ESTÁGIOS (2SLS)**

WOOLDRIDGE, CAP. 15 *

Aula 18 (02 DE DEZEMBRO)

13 MODELOS COM VARIÁVEIS DEPENDENTES LIMITADAS: MODELOS MPL, LOGIT E PROBIT

WOOLDRIDGE, CAP. 17 *

Aula 19 (06 DE DEZEMBRO)

14 TRANSFORMAÇÃO DE FREQUÊNCIA DE DADOS

Aula 20 (09 DE DEZEMBRO)

15 TESTES DE DIAGNÓSTICOS ADICIONAIS (Teste de Restrições de Wald)

Aula 21 (13 DE DEZEMBRO)

16 DYNAMIC OLS (dols) E FULLY MODIFIED OLS (fmols) - modelos equação única cointegrante

Eviews user guide 2 cap. 26

Notas de aula – FLÁVIO VIEIRA

Aula 22 (06 DE JANEIRO)

MODELOS ARDL – AUTOREGRESSIVOS COM DEFASAGENS DISTRIBUÍDAS

NOTAS DE AULA PROF. FLÁVIO

Aula 23 (10 DE JANEIRO)

Aula LABORATÓRIO – ELABORAÇÃO DE TRABALHO ECONOMÉTRICO (EM GRUPO)

Aula 24 (13 DE JANEIRO)

Aula LABORATÓRIO – ELABORAÇÃO DE TRABALHO ECONOMÉTRICO (EM GRUPO)

Aula 25 (17 DE JANEIRO)

REVISÃO PARA A PROVA FINAL

Aula 26 (20 DE JANEIRO)

Prova final

Aula 27 (24 DE JANEIRO) ENTREGA DOS TRABALHOS ECONOMÉTRICOS (EM GRUPO)

ENTREGA DAS NOTAS FINAIS: DIA 24 DE JANEIRO das 9 as 11 hs (Sala 1J259 – Prof. Flávio)

6. METODOLOGIA

O curso de Econometria será centrado em duas dimensões. Uma delas de cunho teórico para apresentar aos alunos os diversos modelos / métodos econométricos para que o aluno tenha uma boa base teórica para entender cada um destes modelos, seus usos, suas especificidades e o tipo de dado utilizado na análise econométrica. Uma segunda dimensão é eminentemente de cunho empírico onde serão estimados vários modelos econométricos, os respectivos testes de cada um destes modelos estimados, a interpretação do modelo estimado (coeficiente, estatísticas de testes, probabilidade, etc) para que se possa fazer as devidas inferências destes modelos estimados. A segunda dimensão envolverá, por parte do professor, a utilização de softwares Econométricos (Eviews e Stata).

7. AVALIAÇÃO

- 1 Prova Parcial (40 pontos) 4 de Novembro de 2022

- 1 Prova Final (40 pontos) 20 de Janeiro de 2023
- 1 Trabalho (20 pontos) Grupo máximo de 5 alunos. Entrega 24 de Janeiro de 2023

Prova Substitutiva: Caso algum aluno não obtenha nota superior a 60 pontos, no dia **27 de Janeiro as 9 e 50 hs**, será aplicada uma prova substitutiva cobrindo o material da prova parcial ou o material da prova final dependendo de qual das duas notas for menor.

A prova substitutiva será aplicada **apenas para os alunos que não obtiverem o mínimo de 60 pontos.**

8. BIBLIOGRAFIA

Básica

Gujarati, D.N. **Econometria Básica**. Quarta Edição, Editora Makron Books, 2006.

Wooldridge, J. M. **Introdução à Econometria**: Uma Abordagem Moderna. Quarta Edição, Editora Cengage, 2010.

Morais, I; Stona, F. e Schuck, G. **Econometria Aplicada no Eviews**. Fundação FEE, Porto Alegre, 2016.

Complementar

Bueno, R. de L. da. S. **Econometria de Séries Temporais**. CENGAGE Learning Edições Ltda, 2ª Edição, São Paulo, 2012.

Morettin, P. A. e Toloi, C. M. C. **Análise de Séries Temporais**. Editora Edgard Blucher LTDA, São Paulo, 2004.

Pindyck, R. S. e D. L. Rubinfeld. **Econometria**: Modelos e Previsões. Editora Elsevir, Rio de Janeiro, 2004, 4a Edição.

Stock, J.H. e M.W. Watson **Econometria**. Pearson Education do Brasil, 2004.

Wooldridge, J. M. Applications of Generalized Method of Moments Estimation. **Journal of Economic Perspectives**. Volume 15, Number 4, pp.87–100, 2001

9. APROVAÇÃO

Aprovado em reunião do Colegiado realizada em: ____/____/____

Coordenação do Curso de Graduação: _____



Documento assinado eletronicamente por **Flavio Vilela Vieira, Professor(a) do Magistério Superior**, em 01/09/2022, às 13:43, conforme horário oficial de Brasília, com fundamento no art. 6º, § 1º, do [Decreto nº 8.539, de 8 de outubro de 2015](#).



A autenticidade deste documento pode ser conferida no site https://www.sei.ufu.br/sei/controlador_externo.php?acao=documento_conferir&id_orgao_acesso_externo=0, informando o código verificador **3886873** e o código CRC **4C82474C**.