


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:	Instituto de Economia e Relações Internacionais									
Código:	IEUFU41051		Período/Série:		5o		Turma:		N	
Carga Horária:						Natureza:				
Teórica:	60	Prática:		Total:	60	Obrigatória: (x)		Optativa: ()		
Professor(A):	Flávio Vilela Vieira					Ano/Semestre:		2021-2		
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

Para eventuais materiais adicionais (arquivos ou vídeos), além do que será ministrado em sala de aula, segue abaixo o link da Equipe de Econometria Sem 2 2021 (Microsoft Teams):

<https://teams.microsoft.com/l/team/19%3aY1a0FSdup-Os5bJxSzxo5uD0dHX4nbUMqqm7Wanvi4M1%40thread.tacv2/conversations?groupId=18c3674d-8f85-4d72-b553-a64a1dbb07e3&tenantId=cd5e6d23-cb99-4189-88ab-1a9021a0c451>

Período: de 02 de Maio de 2022 a 20 de Agosto de 2022.

ATIVIDADES / AULAS

Aula 1 (03 de maio)

Apresentação do Programa

AULA 2 (6 de maio)

Importação de dados do excel para o eviews e revisão mqo

aula 3 (10 de maio)

revisão de mqo

AULA 4 (13 de maio)

1. MULTICOLINEARIDADE

GUJARATI, CAP. 10 *

aula 5 (17 de maio)

2. HETEROCEDASTICIDADE

Gujarati, cap.11 *

WOOLDRIDGE, CAP. 8 **

aula 6 (20 de maio)

3. AUTOCORRELAÇÃO

Gujarati, cap.12 *

WOOLDRIDGE, CAP 12 *

aula 7 (24 de maio)

4. modelagem econométrica: forma funcional, ESPECIFICAÇÃO DO MODELO E DIAGNÓSTICOS

GUJARATI CAP.13 *

WOOLDRIDGE, CAP. 9 **

aula 8 (27 de maio)

5. ANÁLISE DE REGRESSÃO BÁSICA COM DADOS DE SÉRIES TEMPORAIS: MODELOS ESTÁTICOS E MODELOS DE DEFASAGENS DISTRIBUÍDAS

WOOLDRIDGE, CAP. 10 *

aula 9 (31 de maio)

6. USO DE MÍNIMOS QUADRADOS COM DADOS DE SÉRIES TEMPORAIS: QUESTÕES ADICIONAIS

WOOLDRIDGE, CAP. 11 *

aula 10 (03 de junho)

7. 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 11 (07 DE JUNHO)

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 12 (10 DE JUNHO)

atividade Assíncrona – microsoft teams

8. 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 (14 DE JUNHO)

REVISÃO PARA A PROVA parcial

AULA 14 (21 DE JUNHO)

PROVA PARCIAL

AULA 15 (24 DE JUNHO)

9. 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 16 (28 DE JUNHO)

10. MÉTODO DOS MOMENTOS GENERALIZADOS (GMM) PARA SÉRIES DE TEMPO

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

aula 17 (01 DE JULHO)**11. MODELOS NÃO-LINEARES (ARCH-GARCH) E TESTE DE DETECÇÃO DE ARCH (ENGLE)**

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

aula 18 (05 DE JULHO)**12. ANÁLISE DE DADOS EM PAINEL: EFEITOS FIXOS, EFEITOS ALEATÓRIOS E TESTE DE HAUSMAN**

WOOLDRIDGE, CAP. 14 *

aula 19 (08 DE JULHO)**13. VARIÁVEIS INSTRUMENTAIS E MÍNIMOS QUADRADOS EM DOIS ESTÁGIOS (2SLS)**

WOOLDRIDGE, CAP. 15 *

AULA 20 (12 DE JULHO)**14. MODELOS COM VARIÁVEIS DEPENDENTES LIMITADAS: MODELOS MPL, LOGIT E PROBIT**

WOOLDRIDGE, CAP. 17 *

AULA 21 (15 DE JULHO)**15 TRANSFORMAÇÃO DE FREQUÊNCIA DE DADOS****AULA 22 (19 DE JULHO)****16 TESTES DE DIAGNÓSTICOS ADICIONAIS (Teste de Restrições de Wald)****AULA 23 (22 DE JULHO)****17 DYNAMIC OLS (dols) E FULLY MODIFIED OLS (fmols) - modelos equação única cointegrante**

views user guide 2 cap. 26

notas de aula – FLÁVIO VIEIRA

AULA 24 (26 DE JULHO)

MODELOS ARDL – AUTOREGRESSIVOS COM DEFASAGENS DISTRIBUÍDAS

NOTAS DE AULA PROF. FLÁVIO

AULA 25 (29 DE JULHO)**REVISÃO PARA A PROVA FINAL****aula 26 (02 DE AGOSTO)****prova final**

ENTREGA DAS NOTAS FINAIS: DIA 18 DE AGOSTO das 8 as 9 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).

As Bases de Dados (formatos para o Eviews e / ou Stata) serão disponibilizadas pelo professor a cada aula através do email dos alunos ou da equipe do Microsoft Teams.

7. AVALIAÇÃO

- 1 Prova Parcial (50 pontos) 21 de Junho de 2022
- 1 Prova Final (50 pontos) 02 de Agosto de 2022

Prova Substitutiva: Caso algum aluno não obtenha nota superior a 60 pontos, no dia **19 de Agosto 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 07/04/2022, às 13:15, 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 **3506315** e o código CRC **A3EBDECB**.

Referência: Processo nº 23117.022031/2022-23

SEI nº 3506315