



UNIVERSIDADE FEDERAL DE JUIZ DE FORA  
FACULDADE DE ECONOMIA  
DEPARTAMENTO DE ECONOMIA



## DISCIPLINA: MÉTODOS QUANTITATIVOS II PLANO DE ENSINO

**Professor Sidney Martins Caetano**

E-mail: [sidney.caetano@ufjf.br](mailto:sidney.caetano@ufjf.br)

**Doutoranda Sinara da Silva Anastácio**

E-mail: [sinara.anastacio@estudante.ufjf.br](mailto:sinara.anastacio@estudante.ufjf.br)

### I - OBJETIVO DA DISCIPLINA

Este é um curso de Econometria básica para alunos do primeiro ano de pós-graduação, cujo objetivo é apresentar ao aluno os métodos básicos de Econometria, a partir do modelo de regressão linear, discutindo propriedades dos estimadores e suas hipóteses subjacentes. O foco do curso é na distinção entre a estimação de uma relação de causa e efeito e uma simples correlação. Nesse contexto, são também introduzidas algumas técnicas de estimação usadas na Econometria moderna a fim de preparar o aluno para pesquisa em economia.

### II- PROGRAMA

1. Correlação *versus* Causalidade e novas fronteiras em Econometria
2. Esperança Condicional, Modelo de Projeção Linear
3. Modelo Mínimos Quadrados Ordinários
4. Teoria Assintótica para MQO
5. Inferência
6. Endogeneidade e Variáveis Instrumentais
7. GMM
8. Modelos Básicos de Dados em Painel

### III - DIA - HORA - LOCAL

#### Aulas presenciais:

Quintas-feiras: 08-12h / Faculdade de Economia - Sala 03

#### Monitorias:

Segundas-feiras: 09-11h / Faculdade de Economia – laboratório 01

#### IV - METODOLOGIA DE ENSINO

Aulas expositivas ministradas presencialmente.

#### V - SISTEMA DE AVALIAÇÃO

A Nota Final (NF) será calculada pela seguinte fórmula:  $NF = LIS + AV$ , em que:

- LIS - Listas de exercícios, teóricos e práticos, distribuídas ao longo do trimestre: total de 40 pontos; e
- AV - Avaliação - questões dissertativas/quantitativas/qualitativas: primeira avaliação 30 pontos; e segunda avaliação 30 pontos. Total de 60 pontos.

Conforme Regimento, é “Aprovado” na disciplina, quanto ao aproveitamento, o(a) discente que alcançar Nota Final igual ou superior a setenta por cento ( $NF \geq 70$  pontos) da nota máxima possível de 100 pontos. Além da reprovação por nota, será considerado reprovado, para todos os efeitos previstos no Regimento, o(a) discente que não alcançar frequência mínima de setenta e cinco por cento (75%) na disciplina. Maiores detalhes serão esclarecidos na apresentação do plano de ensino durante a primeira aula.

#### VI - REFERÊNCIAS

##### **Principal:**

Bruce E. Hansen. *Econometrics*. Princeton University Press, 2022.

##### **Complementar:**

Fumio Hayashi. *Econometrics*. Princeton University Press, 2000.

William H. Greene. *Econometric Analysis*, Pearson, 2012.

**Obs.:** Materiais de apoio e outros serão comentados ao longo do curso, tais como slides do curso, livros complementares, artigos científicos, textos para discussão, fontes de séries econômicas, links sobre economia, sítios oficiais etc. Estes últimos, as atividades avaliativas (listas de exercícios, teóricas e práticas), entre outros, serão disponibilizados aos discentes por meio da plataforma Google Sala de Aula (<https://classroom.google.com>). Logo, é importante os discentes acompanharem sistematicamente a plataforma. Quaisquer dúvidas perguntem.