

ME715A - Econometria

2º Semestre de 2023

Professor: Carlos Trucíos
E-mail: ctrucios@unicamp.br
Sala: 206 - IMECC

Aulas: Terças e quintas-feiras das 10h às 12h no PB02
Site da Disciplina: <https://ctruciosm.github.io/ME715>

Atendimento: Terças e quintas-feiras das 13h às 14h na Sala 206 - IMECC
(com prévio agendamento via email).

1 INFORMAÇÕES GERAIS E NORMAS

- A leitura deste documento em sua integralidade é fortemente recomendada, não cabendo aos/às alunos/as desculpas por ignorância quanto ao seu conteúdo.
- Comunicação por email: APENAS pelo email institucional, especificando [ME715] no assunto da mensagem.
- Será utilizado o Google Class como ferramenta de apoio à disciplina (comunicações, listas de exercícios e outras atividades serão divulgados pela plataforma).

[G_ME715A_2023S2](#)

- **O/a aluno/a deverá ter frequência mínima de 75% nas aulas.** O abono de faltas se dará de acordo com o [Regimento Geral de Graduação, Seção X, Artigo 72](#).
- No caso de ausência em uma das duas provas, por motivo não previsto no Regimento, a justificativa deverá ser documentada, para a análise do professor. Se a justificativa for aceita, o aluno poderá fazer o Exame como prova substitutiva da nota faltante, entrando no cálculo da Média Final (MF) com o peso correspondente. O critério de aproveitamento será então aplicado; caso $2,5 \leq MF < 6,0$, o Exame será usado também para o cálculo da Nota Final (NF), não havendo outro exame. O Exame poderá substituir somente uma das notas, P_1 ou P_2 . Caso o aluno não compareça às duas provas, ambas P_1 e P_2 serão iguais a zero.
- Casos não contemplados neste documento, serão devidamente avaliados.

2 DETALHES SOBRE A DISCIPLINA

OBJETIVO:

- **Geral:** apresentar os fundamentos teóricos de diversos modelos econométricos
- **Específicos:** capacitar o estudante para compreender e implementar diversos modelos econométricos, bem como identificar em que circunstâncias eles podem ser utilizados.

Ao terminar a disciplina, espera-se que o/a aluno/a entenda os fundamentos teóricos de diversos modelos econométricos e saiba como implementá-los computacionalmente em R, Python e Julia

METODOLOGIA:

- As aulas serão teóricas e práticas, sendo ministradas de forma expositiva e dialogada. Serão realizadas diversas atividades dentro e fora da sala de aula visando desenvolver competências diversas no/a aluno/a.
- Os/As alunos/as serão fortemente encorajados/as a implementar suas próprias rotinas computacionais e compará-las com implementações já disponíveis.

EMENTA:

Revisão de técnicas de regressão. Extensões. Equações simultâneas. Mínimos quadrados generalizados. Variáveis instrumentais. Identificação. Estimação em sistemas.

3 BIBLIOGRAFIA

BÁSICA

- Wooldridge, J. (2023). Introdução a Econometria: Uma abordagem econometrica. 7ed. Cengage Learning.
- Heiss, F. (2020). Using R for Introductory Econometrics. 2ed.
- Heiss, F., & Brunner, D. (2022). Using Python for Introductory Econometrics.
- Heiss, F., & Brunner, D. (2023). Using Julia for Introductory Econometrics.

COMPLEMENTAR

- Greene, W. H. (2003). *Econometric Analysis*. Pearson Education.
- Johnston, J., DiNardo, J. (1997). *Econometric Methods*. Mc Graw Hill, 4ed
- [Hanck, C., Arnold, M., Gerber, A., and Schmelzer, M. \(2023\). *Introduction to Econometrics with R* \(Online book\)](#)
- Hill, R. C., Griffiths, W. E., Judge, G. G. (2010). *Econometria*. Saraiva, 3ed
- Stock, J. H., Watson, M. W. (2020). *Introduction to Econometrics*. Pearson, 4ed (Global)

Para acessar livros digitais fora da Unicamp, você precisará do VPN. Veja instruções de instalação [aqui](#).

4 CRITÉRIOS DE AVALIAÇÃO

A avaliação do curso será composta por duas provas (P_1 e P_2) e participação em sala de aula (P_{sa}). A Média Geral (MG) será dada pela seguinte fórmula:

$$MG = \begin{cases} 0.4 \times P_1 + 0.4 \times P_2 + 0.2 \times P_{sa} & \text{se } \max\{P_1, P_2\} \geq 5 \\ 0.5 \times P_1 + 0.5 \times P_2 & \text{se } \max\{P_1, P_2\} < 5 \end{cases}$$

A participação em sala de aula (P_{sa}) será feita semanalmente, através da solução das listas de exercícios no quadro/computador.

Aprovação

Pelo [Regimento Geral de Graduação, Seção I, Artigo 57](#), estabelecemos os seguintes critérios para aprovação e exame.

- Se $MG \geq 6$, está aprovado/a e $MF = MG$.
- Se $2.5 \leq MG < 6$ e frequência mínima de 75%, deverá fazer o Exame (E).
- Se $MG < 6$ e frequência inferior a 75%, está reprovado/a por frequência.
- Se $MG < 2.5$, está reprovado/a e $MF = MG$.
- Para o/a aluno/a que ficar de exame, a Média Final (MF) será

$$MF = \min\left(6.0, \frac{MG + E}{2}\right).$$

Nesse caso, se $MF \geq 5$, está aprovado/a. Caso contrário, está reprovado/a.

5 DATAS IMPORTANTES

28/09 Prova 1.
28/11 Prova 2.
12/12 Exame.

6 PROGRAMA

Os tópicos do curso estão disponíveis no site:

<https://ctruciosm.github.io/ME715>