

UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARANÁ

PROGRAMA PROFISSIONAL DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA (PPGEcon)

Disciplina: Econometria Aplicada I

Professor: Adalto Acir Althaus Junior (adalto.althaus@ufpr.br)

Objetivos

Oferecer aos alunos conhecimentos de métodos econométricos utilizados em estudos de economia, finanças e finanças corporativas. O aluno terá contato com técnicas de análise de dados cross sectional e em painel além do uso de variáveis instrumentais. Não serão trabalhados métodos avançados, mas fornecidas breves noções para análise de dados por modelos de escolha discreta: *logit e probit*, e outros modelos mais avançados (diferenças em diferenças; *propensity score matching*; ...)

Pré-requisito

Conhecimentos de estatística, testes de hipótese e fundamentos de regressão simples e múltipla.

Metodologia

O curso tem enfoque teórico e prático com atividades desenvolvidas inteiramente com o uso de recursos computacionais. O professor atuará como facilitador e orientador dos alunos, mediante a exposição da matéria e discussões em sala, além de coordenar as atividades em classe.

Avaliação

Critério de aprovação: nota mínima de 70% de aproveitamento. Frequência mínima igual ou superior a 75%. A avaliação será feita da seguinte forma:

- Exercícios: entrega em duplas no início da aula subsequente, computando 35% da nota
- Resumos de 1 pág dos artigos: entrega em grupos de 3 ou 4 alunos, computando 15% da nota
- Trabalho da disciplina: entrega individual e representando 30% da nota
- Prova final: individual, com consulta, representando 20% da nota.

Todos os **trabalhos, exercícios e resumos** devem ser entregues em arquivo de formato word ou pdf (docx ou pdf). Uma cópia do arquivo “dofile” com o código utilizado para atingir os resultados econométricos, devem ser entregues conjuntamente com as respostas dos exercícios. As entregas devem ser feitas na plataforma teams ou conforme indicado pelo professor.

Os **exercícios** compreendem a aplicação de conhecimentos de econometria introduzidos no curso e deverão ser concluídos pelo aluno que precisará buscar o conhecimento adicional necessário para sua realização. Os exercícios serão distribuídos pelo professor conforme o andamento da disciplina.

A **prova final** será de caráter individual, com consulta livre pelo aluno a materiais escritos, impressos ou não. Arquivos de vídeo e áudio não são permitidos. O uso de recursos de comunicação como whatsapp, e-mail, redes sociais e outros quaisquer não são permitidos e qualquer utilização implicará em conduta antiética do aluno e sua consequente reprovação no curso. A consulta permitida é estritamente em materiais bibliográficos, ainda que acessados via web.

O **trabalho da disciplina** compreende um ensaio econométrico, de livre escolha do aluno, em formato de artigo, contendo até 8 páginas no total. Deve abordar clara e resumidamente a justificativa do tema escolhido; teoria subjacente; problema ou questão abordada; descrição da fonte, coleta e base de dados utilizada; estatísticas descritivas e as tabelas de resultados econométricos (profissionalmente formatadas); análise dos resultados e conclusões do estudo. Limitações sobre a possibilidade de generalização dos resultados, bem como os possíveis vieses e como fez para obter as estimativas

econométricas são itens essenciais para uma discussão satisfatória dos resultados e conclusões. Um ensaio econométrico com as técnicas abordadas no curso é obrigatório e sua falta ou incorreção implicará numa avaliação insatisfatória do trabalho.

Programa do Curso

Aula	Tema do Encontro	Atividade	Data	Entregas
01	APRESENTAÇÃO GERAL DA DISCIPLINA REGRESSÃO SIMPLES: OLS	Slides Parte 1 Exercício 1	16.05.2023	Sem entregas
02	REGRESSÃO MÚLTIPLA	Slides Parte 1 e 2 Exercício 2	23.05.2023	Exercício 1
03	CAUSALIDADE; APLICAÇÕES POOLED OLS	Slides Parte 3 e 4	30.05.2023	Paper 1
04	DADOS EM PAINEL	Slides Parte 4 e 5 Exercício 3	06.06.2023	Exercício 2 Paper 2
05	DADOS EM PAINEL VARIÁVEL INSTRUMENTAL MODELOS DE ESCOLHA DISCRETA	Slides Parte 5 + extra Exercício 4	13.06.2023	Paper 3
06	TÓPICOS AVANÇADOS; DISCUSSÃO GERAL	Slides Parte 5 + extra Individual	19.06.2023	Exercício 3
07	AVALIAÇÃO FINAL	Individual	20.06.2023	Exercício 4
08	ENTREGA DO TRABALHO FINAL	Individual	10.07.2023	Trabalho Individual

RECURSOS utilizados para ensino

- **Microsoft Teams** – será utilizado para disponibilizar o material didático e de apoio, tirar dúvidas e para as aulas, além da entrega das atividades, exercícios e trabalhos. Caso seja necessária uma plataforma alternativa, será comunicado pelo professor.

- **Aulas serão presenciais e com atividades remotas ao vivo utilizando alguns recursos do Microsoft Teams.** Caso seja necessária alguma outra ferramenta para as aulas, plataforma alternativa, será comunicado pelo professor.

- **Avaliações Individuais (Prova)** – as provas individuais serão realizadas presencialmente. Caso seja necessário poderá ocorrer de forma alternativa pela plataforma Microsoft Teams ou outra que será comunicado pelo professor no momento oportuno a realização da avaliação.

BIBLIOGRAFIA

Livros:

1. INTRODUÇÃO À ECONOMETRIA UMA ABORDAGEM MODERNA

Wooldridge, J.M. Introdução a Econometria: uma abordagem moderna - tradução da 2a edição norte-americana. Thomson(Cengage Learning), 2007.

2. MOSTLY HARMLESS ECONOMETRICS: AN EMPIRICIST'S COMPANION

Angrist, JD; Pischke, JS. Mostly harmless econometrics: An empiricist's companion. Princeton Uni. Press, 2008.

Artigos/Papers:

1. La Porta, Rafael; Lopez-de-Silanes, Florencio; Shleifer, Andrei & Vishny, Robert W. Law and Finance. **Journal of Political Economy**, Vol. 106, no. 6, 1113-1155, 1998. doi:10.1086/250042
2. Deloof, Marc. Does Working Capital Management Affect Profitability of Belgian Firms? **Journal of Business Finance & Accounting**, Vol. 30, Issue 3, 573-588, 2003. doi:10.1111/1468-5957.00008
3. Gormley, Todd. The impact of foreign bank entry in emerging markets: Evidence from India. **Journal of Financial Intermediation**, Vol. 19, Issue 1, 26-51, 2010. doi:10.1016/J.JFI.2009.01.003