



**CENTRO DE CIÊNCIAS JURÍDICAS E ECONÔMICAS
DEPARTAMENTO DE ECONOMIA**

Plano de Ensino			
Universidade Federal do Espírito Santo		Campus: Goiabeiras	
Curso: Ciências Econômicas			
Departamento Responsável: Departamento de Economia			
Data de aprovação (Art. Nº 91): 06/10/201			
DOCENTE PRINCIPAL: Guilherme Armando de Almeida Pereira			
Qualificação/link para o Currículo Lattes: http://lattes.cnpq.br/5139328860920389			
Disciplina: Econometria II		Código: ECO-03723	
Período: 2021.2		Turma: I	
Pré-requisito: ECO-03719		Carga Horária Semestral: 60	
Créditos: 60	Distribuição da Carga Horária Semestral		
	Teórica	Exercício	Laboratório
	60h		
Ementa: Modelos de equações simultâneas. Modelos com variável dependente binária: Logit, Probit. Modelos com variável dependente limitada: Tobit. Modelos de dados em painel: efeitos fixos, efeitos aleatórios, testes. Variáveis explicativas endógenas: variáveis instrumentais. MQO 2 estágios. Econometria das séries temporais: conceitos básicos.			
Objetivos Específicos: A disciplina dá sequência ao estudo da econometria, agora do ponto de vista mais aplicado. Assim, o aluno tomará conhecimento de várias extensões do modelo linear de regressão, estudado em econometria I, suas aplicações e implementação prática.			

Conteúdo Programático:

Tópico 1: Revisão de análise de regressão e introdução à inferência causal.

- Relações causais e regressão.
- Viés de variável omitida.
- Regressão como método de pareamento.

Tópico 2: Métodos de dados em painel.

- Estimador agrupado.
- Efeitos fixos e efeitos aleatórios.
- Diferenças em diferenças.

Tópico 3: Variáveis instrumentais.

- Variáveis omitidas.
- Mínimos quadrados em dois estágios (MQ2E).
- Teste de endogeneidade e teste de restrições sobreidentificadoras.

Tópico 4: Modelos estruturais de equações simultâneas.

- Viés de simultaneidade.
- Condições de identificações.
- Estimação: MQ2E.

Tópico 5: Modelos de variáveis dependentes limitadas.

- Modelo de probabilidade linear.
- Probit e Logit.
- Tobit.

Tópico 6: Pareamento.

- Pareamento simples.
- Pareamento via escore de propensão.

Tópico 7: Introdução à econometria de séries temporais

- O problema da regressão com séries não estacionárias.
- Conceitos básicos: estacionariedade, raiz unitária, função de autocorrelação, função de autocorrelação parcial etc.

Metodologia:

Aproximadamente 50% de aulas síncronas. As aulas síncronas serão realizadas todas as terças-feiras. A carga horária assíncrona será constituída por leitura dirigida de capítulos dos livros, notas de aulas, resolução das listas de exercícios e vídeos disponibilizados. Como suporte utilizaremos o Google Classroom.

Critérios / Processo de avaliação da aprendizagem:

A avaliação do curso será feita por meio de dois trabalhos a serem desenvolvidos ao longo do semestre: duas listas de exercícios, a primeira correspondendo a 50 % e a segunda a 50% da média do semestre.

Os alunos que obtiverem média do semestre igual ou superior a 7 (sete) estarão dispensados da prova final, cujo conteúdo compreende toda a matéria ministrada no curso. A média final será a média simples entre a prova final e a média do semestre ($MF = \frac{MS+PF}{2}$). O aluno com média final igual ou superior a cinco será aprovado. Provas de 2ª chamada somente ocorrerão nos casos previstos em lei, após análise de pedidos de amparo legal na PROGRAD.

Bibliografia Básica:

- WOOLDRIDGE, J. M.. **Introdução à econometria: uma abordagem moderna**. 3ª ed. São Paulo: Pioneira Thomson Learning, 2006.
- MENEZES FILHO, N. (Org.). *Avaliação Econômica de Projetos Sociais*. Fundação Itaú Social, 2016. Disponível: http://www.redeitausocialdeavaliacao.org.br/wpcontent/uploads/2016/03/LIVRO_Av_Economica_2e_2_0160301.pdf
- GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C.. **Econometria básica**. 5ª ed. Porto Alegre: McGrawHill/Bookman, 2011.
- Notas de aula.
- DE LOSSO, R.. **Econometria de series temporais**. 2ª ed. São Paulo: Cengage,2011 .

Bibliografia Complementar:

- PEREDA, P. C. & ALVES, D.. **Econometria Aplicada**, Elsevier, 2018.
- ANGRIST, J. D. & PISCHKE, J-S.. **Mastering Metrics: the path from cause to effect**. Princeton University Press, 2015.
- HEISS, F.. **Using R for Introductory Econometrics**, 2016. Disponível em: <http://www.urfie.net/read.html>
- SHIKIDA, C. & FERNANDEZ, R. N.. *Notas Introdutórias em Econometria Aplicada Usando R/Rstudio*. Disponível em: <http://wp.ufpel.edu.br/cdshikida/files/2016/10/MinicursoEconometriaRStudio.pdf>
- STOCK, J. H.; WATSON, M.. *Econometria*. São Paulo: Addison Wesley, 2004.
- ENDERS, W. *Applied econometric time series*. John Wiley & Sons, 2008.

Observações:**Cronograma:**Aulas Programadas

09/nov Aula síncrona
16/nov Aula síncrona
23/nov Aula síncrona
30/nov Aula síncrona
07/dez Aula síncrona
14/dez Aula síncrona
16/dez Aula síncrona
25/jan Aula síncrona
01/fev Aula síncrona
08/fev Aula síncrona
15/fev Aula síncrona
22/fev Aula síncrona
08/mar Aula síncrona
10/mar Aula síncrona
15/mar Aula síncrona
22/mar Aula síncrona