



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

<b>Plano de Ensino</b>					
Universidade Federal do Espírito Santo			Campus:	<b>Goiabeiras</b>	
Curso:	<b>CIÊNCIAS ECONÔMICAS</b>				
Departamento Responsável:	<b>ECONOMIA</b>				
Data de Aprovação (Art. nº 91):	<b>22/03/2022</b>				
Docente Responsável:	Guilherme Armando de A. Pereira				
Qualificação/link para o Currículo Lattes:	<a href="http://lattes.cnpq.br/5139328860920389">http://lattes.cnpq.br/5139328860920389</a>				
Disciplina:	<b>ECO-03723</b>		Código:		
Pré-requisito:	<b>ECO-03719</b>		Carga Horária Semestral:	<b>60</b>	
Créditos:	Distribuição da Carga Horária Semestral				
	<b>04</b>	Teoria	Exercício	Laboratório	
		<b>60</b>	---	---	
<b>Ementa:</b>					
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.					
<b>Objetivos Específicos:</b>					
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.					
<b>Conteúdo Programático:</b>					
Tópico 1: Revisão de análise de regressão e introdução à inferência causal. <ul style="list-style-type: none"><li>• Relações causais e regressão.</li><li>• Viés de variável omitida.</li><li>• Regressão como método de pareamento.</li></ul>					
Tópico 2: Métodos de dados em painel. <ul style="list-style-type: none"><li>• Estimador agrupado.</li><li>• Efeitos fixos e efeitos aleatórios.</li><li>• Diferenças em diferenças.</li></ul>					
Tópico 3: Variáveis instrumentais. <ul style="list-style-type: none"><li>• Variáveis omitidas.</li><li>• Mínimos quadrados em dois estágios (MQ2E).</li><li>• Teste de endogeneidade.</li></ul>					
Tópico 4: Modelos estruturais de equações simultâneas. <ul style="list-style-type: none"><li>• Viés de simultaneidade.</li><li>• Condições de identificações.</li><li>• Estimação: MQ2E.</li></ul>					
Tópico 5: Modelos de variáveis dependentes limitadas. <ul style="list-style-type: none"><li>• Modelo de probabilidade linear.</li><li>• Probit e Logit.</li><li>• Tobit.</li></ul>					
Tópico 6: Introdução à econometria de séries temporais <ul style="list-style-type: none"><li>• O problema da regressão com séries não estacionárias.</li><li>• Conceitos básicos: estacionariedade, raiz unitária, função de autocorrelação, função de autocorrelação parcial etc.</li></ul>					
<b>Metodologia:</b> Aulas expositivas					

### Critérios/Processo de Avaliação da Aprendizagem:

A avaliação do curso será feita por meio de duas avaliações a serem desenvolvidas ao longo do semestre: uma prova e uma lista de exercício, 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. 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\\_20160301.pdf](http://www.redeitausocialdeavaliacao.org.br/wpcontent/uploads/2016/03/LIVRO_Av_Economica_2e_20160301.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.

### Cronograma:

	Data	Conteúdo	
	28/abr	Tópico 1	
	05/mai	Tópico 1	
	12/mai	Tópico 1	
	19/mai	Tópico 2	
	26/mai	Tópico 2	
	02/jun	Tópico 2	
	09/jun	Tópico 3	
	16/jun	Feriado	
	23/jun	Tópico 3	
	30/jun	Tópico 3	
	07/jul	Tópico 4	
	14/jul	Tópico 4	
	21/jul	Tópico 4	
	28/jul	Tópico 5	
	04/ago	Tópico 5	
	11/ago	Tópico 6	
	18/ago	Tópico 6	