



CENTRO DE CIÊNCIAS JURÍDICAS E ECONÔMICAS
DEPARTAMENTO DE ECONOMIA

| Plano de Ensino | | | | | |
|---|---|-----------|-----------|--------------------------|------------------|
| Universidade Federal do Espírito Santo | | | Campus: | Goiabeiras | |
| Curso: | CIÊNCIAS ECONÔMICAS | | | | |
| Departamento Responsável: | ECONOMIA | | | | |
| Data de Aprovação (Art. nº 91): | 14/03/2024 | | | | |
| Docente Responsável: | Guilherme Armando de A. Pereira | | | | |
| Qualificação/link para o Currículo Lattes: | http://lattes.cnpq.br/5139328860920389 | | | | |
| Disciplina: | Econometria II | | | Código: | ECO-03723 |
| Pré-requisito: | ECO-03719 | | | Carga Horária Semestral: | 60 |
| Créditos: | Distribuição da Carga Horária Semestral | | | | |
| | 04 | Teoria | Exercício | Laboratório | |
| | | 60 | --- | --- | --- |
| 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. <ul style="list-style-type: none">▪ Relações causais e regressão.▪ Viés de variável omitida.▪ Regressão como método de pareamento. Tópico 2: Métodos de dados em painel. <ul style="list-style-type: none">▪ Estimador agrupado.▪ Efeitos fixos e efeitos aleatórios.▪ Diferenças em diferenças. Tópico 3: Variáveis instrumentais. <ul style="list-style-type: none">▪ Variáveis omitidas.▪ Mínimos quadrados em dois estágios (MQ2E).▪ Teste de endogeneidade. Tópico 4: Modelos estruturais de equações simultâneas. <ul style="list-style-type: none">▪ Viés de simultaneidade.▪ Condições de identificações.▪ Estimação: MQ2E. Tópico 5: Modelos de variáveis dependentes limitadas. <ul style="list-style-type: none">▪ Modelo de probabilidade linear.▪ Probit e Logit. Tópico 6: Introdução à econometria de séries temporais <ul style="list-style-type: none">▪ O problema da regressão com séries não estacionárias.▪ Conceitos básicos: estacionariedade, raiz unitária, função de autocorrelação, função de autocorrelação parcial etc. | | | | | |
| Metodologia: Aulas expositivas | | | | | |
| Critérios/Processo de Avaliação da Aprendizagem: | | | | | |

A avaliação do curso será feita por meio de duas provas e duas listas de exercícios computacionais com os seguintes pesos:

- Prova 1 – 40% da nota do semestre.
- Prova 2 – 40% da nota do semestre.
- Lista 1 – 10% da nota do semestre.
- Lista 2 – 10% da nota 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_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 | Tema | Data | Tema |
|--------|-------------|--------|----------------|
| 12/mar | Tópico 1 | 02/mai | Prova 1 |
| 14/mar | Tópico 1 | 07/mai | Tópico 4 |
| 19/mar | Tópico 1 | 09/mai | Tópico 4 |
| 21/mar | Laboratório | 14/mai | Laboratório |
| 26/mar | Tópico 2 | 16/mai | Tópico 5 |
| 28/mar | Tópico 2 | 21/mai | Tópico 5 |
| 02/abr | Tópico 2 | 23/mai | Tópico 5 |
| 04/abr | Tópico 2 | 29/mai | Laboratório |
| 09/abr | Laboratório | 04/jun | Laboratório |
| 11/abr | Laboratório | 06/jun | Tópico 6 |
| 16/abr | Tópico 3 | 11/jun | Tópico 6 |
| 18/abr | Tópico 3 | 13/jun | Tópico 6 |
| 23/abr | Tópico 3 | 18/jun | Tópico 6 |
| 25/abr | Laboratório | 20/jun | Laboratório |
| 30/abr | Laboratório | 25/jun | Prova 2 |

Entrega da Lista 1: Até 14/05

Entrega da Lista 2: Até 25/06

Prova Final: 16/jul