



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):	26/09/2024				
Docente Responsável:	Guilherme Armando de A. Pereira				
Qualificação/link para o Currículo Lattes:	http://lattes.cnpq.br/5139328860920389				
Disciplina:	ECO-03723			Código:	
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 três listas de exercícios computacionais com os seguintes pesos:

- Prova 1 – 30% 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.
- Lista 3 – 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
22/out	Tópico 1	12/dez	Tópico 4
24/out	Tópico 1	17/dez	Tópico 4
29/out	Tópico 1	19/dez	Tópico 4
31/out	Tópico 1	23/jan	Tópico 5
05/nov	Tópico 2	28/jan	Tópico 5
07/nov	Tópico 2	30/jan	Tópico 5
12/nov	Tópico 2	04/fev	Tópico 5
14/nov	Tópico 2	06/fev	Tópico 5
19/nov	Tópico 2	11/fev	Tópico 5
21/nov	Tópico 2	13/fev	Tópico 6
26/nov	Tópico 3	18/fev	Tópico 6
28/nov	Tópico 3	20/fev	Tópico 6
03/dez	Tópico 3	25/fev	Tópico 6
05/dez	Tópico 3	27/fev	Tópico 6
10/dez	Tópico 3	06/mar	Tópico 6