



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):	08/05/2025								
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				
Distribuição da Carga Horária Semestral									
Créditos:	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:	<p>Tópico 1: Revisão de análise de regressão e introdução à inferência causal.</p> <ul style="list-style-type: none">▪ Relações causais e regressão.▪ Viés de variável omitida.▪ Regressão como método de pareamento. <p>Tópico 2: Introdução à econometria de séries temporais</p> <ul style="list-style-type: none">▪ O problema da regressão com séries não estacionárias.Conceitos básicos: estacionariedade, raiz unitária e função de autocorrelação. <p>Tópico 3: Métodos de dados em painel.</p> <ul style="list-style-type: none">▪ Estimador agrupado.▪ Efeitos fixos e efeitos aleatórios.▪ Diferenças em diferenças. <p>Tópico 4: Variáveis instrumentais.</p> <ul style="list-style-type: none">▪ Variáveis omitidas.▪ Mínimos quadrados em dois estágios (MQ2E).▪ Teste de endogeneidade. <p>Tópico 5: Modelos estruturais de equações simultâneas.</p> <ul style="list-style-type: none">▪ Viés de simultaneidade.▪ Condições de identificações.▪ Estimação: MQ2E. <p>Tópico 6: Modelos de variáveis dependentes limitadas.</p> <ul style="list-style-type: none">▪ Modelo de probabilidade linear.▪ Probit e Logit.								
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 – 45% da nota do semestre.
- Prova 2 – 45% da nota do semestre.
- Lista 1, Lista 2 e Lista 3 – As três listas, em conjunto, representam 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 2^a 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.** 3^a 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.** 5^a ed. Porto Alegre: McGrawHill/Bookman, 2011.
- Notas de aula.
- DE LOSSO, R.. **Econometria de series temporais.** 2^o 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/abr	Tópico 1	17/jun	PROVA 1
24/abr	Tópico 1	24/jun	Tópico 4
29/abr	Tópico 1	26/jun	Tópico 4
06/mai	Tópico 2	01/jul	Tópico 4
08/mai	Tópico 2	03/jul	Tópico 5
13/mai	Tópico 2	08/jul	Tópico 5
15/mai	Tópico 2	10/jul	Tópico 4/5
20/mai	Tópico 2	22/jul	Tópico 4/5
22/mai	Tópico 2	24/jul	Tópico 6
27/mai	Tópico 3	29/jul	Tópico 6
29/mai	Tópico 3	30/jul	Tópico 6
03/jun	Tópico 3	05/ago	Tópico 6
05/jun	Tópico 3	07/ago	Tópico 6
10/jun	Tópico 3	12/ago	Revisão
12/jun	Revisão	14/ago	PROVA 2