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):	//2026							
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.
- Relações causais e regressão.
- Viés de variável omitida.
- Regressão como método de pareamento.

Tópico 2: Introdução à econometria de séries temporais
- O problema da regressão com séries não estacionárias.
  Conceitos básicos: estacionariedade, raiz unitária e função de autocorrelação.

Tópico 3: Métodos de dados em painel.
- Estimador agrupado.
- Efeitos fixos e efeitos aleatórios.
- Diferenças em diferenças.

Tópico 4: Variáveis instrumentais.
- Variáveis omitidas.
- Mínimos quadrados em dois estágios (MQ2E).
- Teste de endogeneidade.

Tópico 5: Modelos estruturais de equações simultâneas.
- Viés de simultaneidade.
- Condições de identificações.
- Estimação: MQ2E.

Tópico 6: Modelos de variáveis dependentes limitadas.
- 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 três provas e três listas de exercícios computacionais com os

seguintes pesos:

- Prova 1 – 30% da nota do semestre.
- Prova 2 – 30% da nota do semestre.
- Prova 3 – 30% 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 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.** 2º 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
11/ago	Tópico 1	08/out	Tópico 3
13/ago	Tópico 1	13/out	Tópico 3
18/ago	Tópico 1	15/out	Tópico 3
20/ago	Tópico 2	20/out	Tópico 3
25/ago	Tópico 2	22/out	Revisão
27/ago	Tópico 2	27/out	Prova 2
01/set	Tópico 2	29/out	Tópico 4
03/set	Tópico 2	03/nov	Tópico 5
15/set	Tópico 2	05/nov	Tópico 5
17/set	Revisão	10/nov	Tópico 6
22/set	Prova 1	12/nov	Tópico 6
24/set	Tópico 3	17/nov	Tópico 6
29/set	Tópico 3	19/nov	Tópico 6
01/out	Tópico 3	24/nov	Revisão
06/out	Tópico 3	26/nov	Prova 3