



Departamento de Economia
CENTRO DE CIÊNCIAS JURÍDICAS E ECONÔMICAS

PROGRAMA DA DISCIPLINA

CARACTERIZAÇÃO DA DISCIPLINA						
DISCIPLINA		CRÉDITO	CARGA HORÁRIA	PRÉ-REQUISITO	OBRIG./ OPT.	PERÍODO
CÓDIGO	NOME	04	60 hs	ECO-03719	OPT.	2016/01
ECO-03723	ECONOMETRIA II					
PROFESSOR: Renato Seixas (mlseixas@gmail.com)						

EMENTA
Modelos com variável dependente binária: Modelo Logit; Modelo Probit. Modelos com variável dependente limitada: Modelo Tobit. Modelos para variável censurada e truncada. Modelos de regressão para dados em painel: Modelos de efeito fixo; Modelos de efeito aleatório. O problema das variáveis explicativas endógenas: Estimação de variáveis instrumentais. Mínimos quadrados de dois estágios.

OBJETIVOS DA DISCIPLINA
O curso continua a preparação do aluno para análise empírica de problemas econômicos utilizando métodos de regressão introduzidos em Econometria I. O curso inicia com uma revisão do modelo clássico de regressão em forma matricial e aborda os seguintes tópicos: dados em painel, modelos de equações simultâneas, modelos de séries temporais e modelos para variáveis dependentes limitadas. Outro objetivo é que os alunos iniciem um projeto de pesquisa com conteúdo econométrico já visando a elaboração de monografia.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO
<ol style="list-style-type: none">1. Revisão do modelo clássico em forma matricial<ol style="list-style-type: none">1.1. Especificação e hipóteses1.2. Estimação: MQO e MQG1.3. Matriz de covariância e testes de hipótese1.4. Previsão2. Métodos simples e avançados de dados em painel<ol style="list-style-type: none">2.1. Estimador agrupado2.2. Efeitos fixos2.3. Efeitos aleatórios3. Estimadores de variáveis instrumentais<ol style="list-style-type: none">3.1. Variáveis omitidas e o viés do estimador MQO3.2. Estimação por Variáveis Instrumentais3.3. Mínimo quadrado de dois estágios (MQ2E)3.4. Teste de endogeneidade e teste de restrições sobreidentificadoras3.5. Solução de erros nas variáveis4. Modelos estruturais de equações simultâneas<ol style="list-style-type: none">4.1. Viés de simultaneidade4.2. Condições de identificação4.3. Estimação de sistemas: MQ2E5. Introdução aos modelos de séries temporais<ol style="list-style-type: none">5.1. Exemplos5.2. Estacionariedade e raiz unitária5.3. Testes de estacionariedade5.4. Correlograma5.5. Teste Dickey-Fuller5.6. Cointegração e modelo de correção de erro6. Modelos de variáveis dependentes limitadas<ol style="list-style-type: none">6.1. Modelo de probabilidade linear6.2. Logit6.3. Probit6.4. Tobit



Departamento de Economia
CENTRO DE CIÊNCIAS JURÍDICAS E ECONÔMICAS

BIBLIOGRAFIA

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. **Econometria básica**. 5ª ed. Porto Alegre: McGrawHill/Bookman, 2011, 924p.
HILL, C.; GRIFFITHS, W.; e JUDGE, G. **Econometria**. 2ª ed. São Paulo, Editora Saraiva, 2008. 471p.
WOOLDRIDGE, J. M. **Introdução à econometria: uma abordagem moderna**. 3ª ed. São Paulo: Pioneira Thomson Learning, 2006. 684 p.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

GREENE, W. H. **Econometrics analysis**. 5 ed. New Jersey: Prentice Hall, 2002. 802 p.
PINDYCK, R. S.; RUBINFELD, D. L. **Econometria: modelos e previsões**. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004. 726 p.
MONTGOMERY, D. C.; PECK, E, A.; VINING, G. G. **Introduction to linear regression analysis**. 4 ed. New Jersey: Wiley Interscience, 2006, 612 p.
WOOLDRIDGE, J. M. **Econometric analysis of cross section and panel data**. Cambridge, Mass: MIT Press, 2002.

CRITÉRIOS DE AVALIAÇÃO DA APRENDIZAGEM

O aluno será avaliado por meio de três listas de exercícios ao longo do semestre e por um projeto de pesquisa que deverá ser apresentado em sala, no formato de seminário, ao final do semestre. O aluno deverá elaborar um documento a ser entregue ao professor no último dia de aula (30/06), seguindo diretrizes que serão divulgadas oportunamente. A média do semestre terá dois componentes: média das listas de exercícios ($\frac{L_1+L_2+L_3}{3}$) e nota do projeto de pesquisa ($MS = \frac{ML+NP}{2}$). Para cada lista e projeto será atribuída nota de zero a dez.

Os alunos que obtiverem média final igual ou superior a 7 (sete) estarão dispensados da prova final, cujo conteúdo compreende **toda** a matéria ministrada no curso. Provas de 2ª chamada somente ocorrerão nos casos previstos em lei, a partir de consulta à coordenação do 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.

A frequência às aulas é obrigatória de acordo com as normas da UFES. Será reprovado por falta o estudante que não obtiver no mínimo 75% (setenta e cinco por cento) de frequência.

Prova Final: 06/07