



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):	05/07/2018				
Docente Responsável:	Renato Seixas (renato.seixas@ufes.br)				
Qualificação/link para o Currículo Lattes:	http://lattes.cnpq.br/1824359260532530				
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 seqüência 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, e suas aplicações e implementação prática.				
Conteúdo Programático:	<p>0. Revisão de análise de regressão</p> <p>0.1. Regressão 0.2. Método dos mínimos quadrados: estimação e inferência 0.3. Relações Causais e Regressão 0.4. Viés de variável omitida 0.5. Regressão como método de pareamento</p> <p>1. Métodos simples e avançados de dados em painel</p> <p>1.1. Estimador agrupado 1.2. Efeitos fixos 1.3. Efeitos aleatórios 1.4. Diferença em Diferenças</p> <p>2. Estimadores de variáveis instrumentais</p> <p>2.1. Solução de erros nas variáveis e variáveis omitidas 2.2. Mínimo quadrado de dois estágio (MQ2E) 2.3. Efeito local de tratamento 2.4. Teste de endogeneidade e teste de restrições sobreidentificadoras</p> <p>3. Modelos estruturais de equações simultâneas</p> <p>3.1. Viés de simultaneidade 3.2. Condições de identificação 3.3. Estimação de sistemas: MQ2E</p> <p>4. Modelos de variáveis dependentes limitadas Modelo de probabilidade linear</p> <p>4.2. Probit e Logit 4.3. Dados censurados: modelo Tobit 4.4. Modelos de seleção: Heckman</p> <p>5. Introdução aos modelos de séries temporais</p> <p>5.1. Exemplos 5.2. Propriedades do MQO</p>				

	<p>5.3. Tendência e sazonalidade</p> <p>5.4. Estacionariedade</p> <p>5.5. Propriedades assintóticas do MQO</p> <p>5.6. Correlação serial e heterocedasticidade</p> <p>5.7. Tópicos avançados</p> <p>5.7.1. Modelos de defasagem distribuída</p> <p>5.7.2. Raiz unitária</p> <p>5.7.3. Cointegração</p> <p>5.7.4. Previsão</p>
Metodologia:	Aulas expositivas com a participação dos alunos e aulas no laboratório de informática para uso dos softwares R/R-Studio.
Critérios/Processo de Avaliação da Aprendizagem:	<p>A avaliação do curso será feita por meio de três trabalhos a serem desenvolvidos ao longo do semestre: duas lista de exercícios, a primeira correspondendo a 25% e a segunda a 35% da média do semestre, e um referee report, correspondendo a 40% da média do semestre, sobre algum artigo acadêmico empírico publicado em revista especializada. Cada lista e o referee report serão avaliados em escala de zero a dez.</p> <p>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.</p> <p>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.</p> <p>1ª Entrega: 2ª Entrega: 3ª Entrega: Prova Final:</p>
Bibliografia Básica:	<ul style="list-style-type: none"> • WOOLDRIDGE, J. M. Introdução à econometria: uma abordagem moderna. 3 ed. São Paulo: Pioneira Thomson Learning, 2006. 684 p. • STOCK, J. H.; WATSON, M. Econometria. São Paulo: Addison Wesley, 2004. 485 p. • GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. Econometria básica. 5ª ed. Porto Alegre: McGrawHill/Bookman, 2011, 924p.
Bibliografia Complementar:	<ul style="list-style-type: none"> • 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". Manuscrito, 2016. Disponível em: http://wp.ufpel.edu.br/cdshikida/files/2016/10/MinicursoEconometriaRStudio.pdf • ANGRIST, J. D. & PISCHKE, J-S. "Mastering 'Metrics: the path from cause to effect". Princeton University Press, 2015. • MENEZES FILHO, N. (Org.) "Avaliação Econômica de Projetos Sociais", Fundação Itaú Social, 2016. Disponível em: http://www.redeitausocialdeavaliacao.org.br/wp-content/uploads/2016/03/LIVRO_Av_Economica_2e_20160301.pdf • HILL, C.; GRIFFITHS, W.; e JUDGE, G. Econometria. 2 ed. São Paulo, Editora Saraiva, 2008. 471p