

PLANO DE ENSINO

I. IDENTIFICAÇÃO

Curso: Ciências Econômicas	
Departamento: Departamento de Ciências Econômicas	
Disciplina: Econometria III	Código: 63ECON2
Carga horária: 72 horas	Período letivo: 2024.2
Professor: Rafael Felipe Bressan	
Contato: rafael.bressan@edu.udesc.br	

II. EMENTA

Modelos de regressão com dados de painel. Modelo com efeitos fixos. Modelo com efeitos aleatórios. Variáveis instrumentais. Mínimos quadrados em dois estágios. Modelos de equações simultâneas. O problema da identificação. Método de estimação de máxima verossimilhança. Método generalizado dos momentos. O teste de Hausman. Modelos de escolha qualitativa.

III. OBJETIVOS

Neste curso você aprenderá algumas das principais ferramentas atualmente utilizadas em *microeconometria*. Modelos com dados em painel, regressão com efeitos-fixos, diferença-em-diferenças, modelos de equações simultâneas, variáveis instrumentais e mínimos quadrados em dois estágios (MQ2E) e, modelos com variável dependente limitada.

Você também aprenderá a usar a linguagem de programação Python (e um pouco de R) para fazer as manipulações de dados, estimações e testes de hipóteses, entretanto, este **não** é um curso de Python ou R e uma leitura complementar é sugerida.

Serão apresentados alguns tópicos mais especializados, que vão além dos cursos introdutórios. O ponto de partida é a retomada dos principais tipos de vies inerentes aos modelos econométricos tradicionais para chegar às análises que respondem a questões mais atuais da ciência moderna.

Espera-se instigar a curiosidade do estudante sobre as técnicas que podem fornecer melhores medidas de ajuste dos dados aos modelos econométricos. Ao final, espera-se que o estudante seja capaz de compreender e aplicar modelos dinâmicos, de séries temporais, painel, sistemas de equações e variáveis instrumentais.

IV. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

Parte I – Causalidade e o *framework* de Resultados Potenciais de Rubin.

Parte II – Modelos de equações simultâneas, o problema da identificação, revisão dos principais tipos de vies de estimação. Condição de Classificação e de Ordem. Mínimos Quadrados Indiretos. Variável Instrumental. Estimação de VI no modelo de regressão múltipla. Mínimos Quadrados em 2 Estágios. Teste de endogeneidade e de sobreidentificação.

Parte III – Dados em Painel. Vies de heterogeneidade não observada. Estimação de Efeitos Fixos. Variação intragrupo e entre-grupos. Expansão em variáveis dummies e primeira diferença. Efeitos Aleatórios. Método das diferenças em diferenças (DID). Grupos controle e tratamento. DID em forma de regressão. Nova literatura de DID com adoção ao tratamento escalonada

Parte IV - Modelos de Escolha Qualitativa. Modelos de Probabilidade Linear, Logit e Probit. Estimação de Máxima Verossimilhança. Interpretação das estimativas Logit e Probit. Efeito Marginal, Efeito Médio e Efeito na Média. Método dos Momentos Generalizado (GMM).

V. METODOLOGIA DE ENSINO

- Aula expositiva/dialogada através da utilização do recurso de projeto e quadro, elaboração de exercícios de forma individual e/ou em grupos para fixação do conteúdo.
- Os alunos poderão tirar suas dúvidas através da monitoria quando disponível, agendada através do Moodle ou, em casos excepcionais onde a dúvida não seja sanada pela monitoria, conversa com o professor após o término da aula ou via e-mail.
- O meio de comunicação preferencial do professor com os alunos será através do e-mail corporativo da UDESC. Avisos importantes sobre o cronograma da disciplina também serão feitos através do Moodle.
- Todo o material necessário para o acompanhamento da disciplina será disponibilizado pelo professor, na página da disciplina no Moodle. Assim, não haverá necessidade de o aluno ter os livros de forma física, muito embora a biblioteca possua os livros texto indicados em seu acervo.
- Listas de exercícios estarão disponíveis para os alunos estudarem para as provas.

VI. SISTEMA DE AVALIAÇÃO.

- O sistema de avaliação da disciplina se dará da seguinte maneira:
- 1 Lista de exercícios de revisão valendo 10% da nota final.
 - 2 Provas escritas, presenciais, com os seguintes pesos: 30% e 30%.
 - 1 Trabalho econométrico **individual** de cunho prático com 30% de peso.
 - É obrigatória a frequência em no mínimo 75% das aulas para aprovação.
 - As provas de segunda chamada serão realizadas apenas mediante o que consta na resolução no 039/2015-CONSEPE.

Informações sobre realização de Prova de 2ª Chamada

A Resolução nº 039/2015-CONSEPE regulamenta o processo de realização de provas de segunda chamada.

Segundo esta resolução, o aluno que deixar de comparecer a qualquer das avaliações nas datas fixadas pelos professores, poderá solicitar segunda chamada de provas na Secretaria de Ensino de Graduação e/ou Secretaria do Departamento através de requerimento por ele assinado e respectivos comprovantes, **no prazo de 5 (cinco) dias úteis**, contados a partir da data de realização da avaliação, sendo aceitos pedidos, devidamente comprovados, motivados por:

- I - problema de saúde do aluno ou parente de 1º grau, devidamente comprovado, que justifique a ausência;
- II - ter sido vítima de ação involuntária provocada por terceiros, comprovada por Boletim de Ocorrência ou documento equivalente;
- III - manobras ou exercícios militares comprovados por documento da respectiva unidade militar;
- IV - luto, comprovado pelo respectivo atestado de óbito, por parentes em linha reta (pais, avós, filhos e netos), colaterais até o segundo grau (irmãos e tios), cônjuge ou companheiro (a), com prazo de até 5 (cinco) dias úteis após o óbito;
- V - convocação, coincidente em horário, para depoimento judicial ou policial, ou para eleições em entidades oficiais, devidamente comprovada por declaração da autoridade competente;
- VI - impedimentos gerados por atividades previstas e autorizadas pela Chefia de Departamento do respectivo curso ou instância hierárquica superior, comprovada através de declaração ou documento equivalente;
- VII - direitos outorgados por lei;
- VIII - coincidência de horário de outras avaliações do próprio curso, comprovada por declaração da chefia de departamento;
- IX – convocação para competições oficiais representando a UDESC, o Município, o Estado ou o País;

X – convocação pelo chefe imediato, no caso de acadêmico que trabalhe, em documento devidamente assinado e carimbado, contendo CNPJ da empresa ou equivalente, acompanhado de documento anexo que comprove o vínculo empregatício, como cópia da carteira de trabalho ou do contrato ou de documento equivalente.

Leia a resolução na íntegra na página da Secretaria dos Conselhos

VII – BIBLIOGRAFIA

Livro-texto

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. Introdução à econometria: uma abordagem moderna. São Paulo: Cengage Learning, 2016. Tradução da 4ª edição norte-americana por José Antonio Ferreira.

GUJARATI, Damodar N.; PORTER, Dawn C. Econometria básica. Porto Alegre: Amgh Editora, 2011. - 5. ed.

GERTLER, Paul J. et al. Avaliação de Impacto na Prática, 2018. - 2. ed. Banco Mundial.

PEIXOTO, Betânia et al. Avaliação econômica de projetos sociais. Fundação Itaú Social, 3ª ed, 2017.

CUNNINGHAM, Scott. Causal Inference: The Mixtape, New Haven: Yale University Press, 2021. URL: <https://mixtape.scunning.com/>

HANSEN, Bruce E. Econometrics. Manuscript, revision of February 2020.

ANGRIST, Joshua D.; PISCHKE, Jörn-Steffen. Mostly harmless econometrics: An empiricist's companion. Princeton university press, 2009.

ANGRIST, Joshua D.; PISCHKE, Jörn-Steffen. Mastering'metrics: The path from cause to effect. Princeton university press, 2014. URL: <http://www.masteringmetrics.com/>

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data. MIT press, 2010. Second Edition.

Programação em R

FREIRE, Sergio M. Introdução ao R. 2021. URL: <http://www.lampada.uerj.br/introducaoaoR>

R Core Team. An Introduction to R. URL: <https://cran.r-project.org/doc/manuals/r-release/R-intro.html>

HANCK, Christoph et al. Introduction to Econometrics with R. University of Duisburg-Essen, 2019. URL: <https://www.econometrics-with-r.org/>

HEISS, Florian. Using R for Introductory Econometrics. URL: <http://urfie.net/>

WICKHAM, Hadley; GROLEMUND, Garrett. R for data science: import, tidy, transform, visualize, and model data. O'Reilly Media, Inc., 2016. URL: <https://r4ds.had.co.nz/>

Programação em Python

SHEPPARD, Kevin. Introduction to Python for econometrics, statistics and data analysis. Self-published, University of Oxford, 5th edition, 2021. URL: <https://www.kevinshppard.com/teaching/python/notes/>

SARGENT, Thomas; STACHURSKI, John. QuantEcon Lectures. URL:

<https://quantecon.org/lectures/>