

PLANO DE ENSINO

I. IDENTIFICAÇÃO

Curso: Ciências Econômicas

Departamento: Ciências Econômicas

Disciplina: Econometria III

Código: 63ECON3

Carga horária: 72 horas **Período letivo:** 2025.2

Termo: 6º

Professor: Fernando Pozzobon

Contato: fernando.pozzobon@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

Estimular nos alunos o desenvolvimento e a análise de estimativas melhor ajustadas, através de testes, diagnósticos e correções dos modelos de painel e sistemas de equações. Em especial, compreender a natureza e aplicações de modelos dinâmicos, de séries temporais, painel, sistemas de equações e variáveis instrumentais. Conhecer e realizar aplicações e simulações utilizando técnicas econométricas.

IV. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

Parte I: Modelos de equações simultâneas, o problema da identificação, variáveis instrumentais, MQ2E;

Parte II: Modelos de regressão com dados de painel: modelos de efeitos fixos, efeitos aleatórios e teste de Hausman;

Parte III: Modelos de escolha qualitativa, método generalizado dos momentos, estimação de máxima verossimilhança.

V. METODOLOGIA DE ENSINO

Aula expositiva/dialogada com elaboração de exercícios de forma individual ou em grupo e utilização de outros instrumentos didático-pedagógicos que auxiliem na compreensão do conteúdo. Os exercícios práticos, quando indicado pelo professor, poderão ser desenvolvidos com o auxílio de programas econométricos.

*obs: as aulas na modalidade presenciais ou não presencial dependerão das normativas da UDESC e das condições da UDESC/ESAG em atender com segurança as normas vigentes.

VI. SISTEMA DE AVALIAÇÃO

A avaliação será feita através de duas provas individuais, com peso na nota final do semestre de 40% cada e um estudo de caso envolvendo as técnicas e metodologia vistas na disciplina de Econometria III, valendo 20% na nota final.

VII. BIBLIOGRAFIA

Básica

GUJARATI, Damodar N. **Econometria Básica**. Rio de Janeiro: Campus, 2006.

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. **Introdução à Econometria**: Uma Abordagem Moderna. São Paulo: Thomson, 2006.

HILL, R. Carter, GRIFFITHS, William E, JUDGE, George G. **Econometria**. São Paulo: Saraiva, 2003. 2.ed.

Complementar

BUENO, R.L.S. **Econometria de Séries Temporais**. São Paulo: Cengage Learning, 2011. 2 ed.

PINDYCK, Robert S, RUBINFELD, Daniel L. **Econometria**: modelos e previsões. Rio de Janeiro: Campus, 2004.

HOFFMANN, Rodolfo. **Análise de Regressão**: Uma Introdução à Econometria. São Paulo: Hucitec, 2006. 4 ed.

MATOS, O.C. de. **Econometria Básica**: teoria e aplicações. São Paulo: Atlas, 2000.

*Bibliografias auxiliares poderão ser indicadas durante o semestre.