

## PLANO DE ENSINO

### I. IDENTIFICAÇÃO

<b>Curso:</b> Ciências Econômicas		
<b>Departamento:</b> Ciências Econômicas		
<b>Disciplina:</b> Econometria III		<b>Código:</b> 63ECON3
<b>Carga horária:</b> 72 horas	<b>Período letivo:</b> 2025.2	<b>Termo:</b> 6º
<b>Professor:</b> Fernando Pozzobon		
<b>Contato:</b> 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.