



## UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA



### FICHA DE COMPONENTE CURRICULAR

<b>CÓDIGO:</b> PECC1050	<b>COMPONENTE CURRICULAR:</b> Econometria III	
<b>UNIDADE ACADÊMICA OFERTANTE:</b> Instituto de Economia e Relações Internacionais		<b>SIGLA:</b> IERI
<b>CH TOTAL TEÓRICA:</b> 60 horas	<b>CH TOTAL PRÁTICA:</b> 0 horas	<b>CH TOTAL:</b> 60 horas

#### 1. OBJETIVOS

O objetivo geral da disciplina é apresentar modelos econométricos para inferência de causalidade a partir de dados em cortes transversais e dados em painel..

#### 2. EMENTA

Modelo de regressão linear; Variáveis Instrumentais; Modelos lineares de dados em painel; Modelos de resultados binários; Modelos multinomiais; Tobit e modelos de seleção; Modelos de dados de contagem; Análise de sobrevivência para dados de duração; Modelos não lineares de dados em painel; Modelos paramétricos para heterogeneidade e endogeneidade; Ensaios de controle randomizados e efeitos de tratamento exógeno; Efeitos de tratamento endógeno; Machine learning; Métodos bayesianos.

#### 3. PROGRAMA

1. Modelos econométricos em cortes transversais e dados em painel
  - 1.1. Mínimos Quadrados Ordinários
  - 1.2. Mínimos Quadrados em 2 estágios.
  - 1.3. Modelos de dados em painel: efeitos fixos, primeira diferença e diferenças em diferenças.
  - 1.4. Modelos de resultados binários: Probit, Logit e Tobit.
2. Métodos avançados para inferência de causalidade de políticas públicas
  - 2.1. Modelo de Seleção de Heckman.
  - 2.3. Modelo de efeitos potenciais. Econometria de avaliação de impacto com tratamento endógeno e exógeno.
  - 2.4. Métodos quase-experimentais.
  - 2.5. Aplicação de métodos econométricos em bases de dados extensas.

#### 4. BIBLIOGRAFIA BÁSICA

WOOLDRIDGE, J. M. **Econometric analysis of cross section and panel data**. MIT press, 2010.

HECKMAN, J. (ed.) **Handbook of econometrics**. Edward Leamer, Elsevier, Amsterdam, 2008.

HAYASHI, F. **Econometrics**. Princeton University Press, 2000.

IMBENS, G.; WOOLDRIDGE, J. Recent developments in the econometrics of program evaluation. **Journal of Economic Literature**, v. 47,n. 1, p. 5-86, 2009.

## 5. BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

ANGRIST, J. D.; PISCHKE, J. S. **Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion**. Princeton University Press, 2009.

GUJARATI, D. **Econometria: princípios, teoria e aplicações práticas**. Saraiva Educação, São Paulo, 2019.

IMBENS, G. W.; RUBIN, D. B. **Causal Inference in Statistics, Social, and Biomedical Sciences**. Cambridge University Press, 2015.

ANGRIST, J. D.; LAVY, V. Using Maimonides' rule to estimate the effect of class size on scholastic achievement. **The Quarterly Journal of Economics**, v. 2, n. 114, 1999.

BARROS, R. P. et al. Uma avaliação do impacto da qualidade da creche no desenvolvimento infantil. **Pesquisa e Planejamento Econômico**, v. 41, n. 2, p. 213-232, Brasília, ago., 2011.

FUJIWARA, T. Voting technology, political responsiveness, and infant health: Evidence from Brazil. **Econometrica**, v. 83, n. 2, p. 423-464, 2015.

BROLLO, F. et al. The political resource curse. **American Economic Review**, v.5, n.103, p. 1759-1796, 2013.

## 6. APROVAÇÃO

Carlos César Santejo Saiani  
Coordenador(a) do PPGE

Haroldo Ramazini Junior  
Diretor(a) do IERI



Documento assinado eletronicamente por **Carlos Cesar Santejo Saiani, Coordenador(a)**, em 14/03/2024, às 10:28, conforme horário oficial de Brasília, com fundamento no art. 6º, § 1º, do [Decreto nº 8.539, de 8 de outubro de 2015](#).



Documento assinado eletronicamente por **Haroldo Ramanzini Junior, Diretor(a)**, em 14/03/2024, às 13:02, conforme horário oficial de Brasília, com fundamento no art. 6º, § 1º, do [Decreto nº 8.539, de 8 de outubro de 2015](#).



A autenticidade deste documento pode ser conferida no site [https://www.sei.ufu.br/sei/controlador\\_externo.php?acao=documento\\_conferir&id\\_orgao\\_acesso\\_externo=0](https://www.sei.ufu.br/sei/controlador_externo.php?acao=documento_conferir&id_orgao_acesso_externo=0), informando o código verificador **5208714** e o código CRC **D3BE752E**.