



FICHA DE COMPONENTE CURRICULAR

| | | |
|--|---|------------------------------|
| CÓDIGO: PECC1034 | COMPONENTE CURRICULAR: Econometria Aplicada | |
| UNIDADE ACADÊMICA OFERTANTE: Instituto de Economia e Relações Internacionais | SIGLA: IERI | |
| CH TOTAL TEÓRICA: 60 horas | CH TOTAL PRÁTICA: 0 horas | CH TOTAL: 60 horas |

1. OBJETIVOS

O objetivo geral da disciplina é introduzir aos alunos os principais conceitos, modelos, testes e aplicações econométricas. Para isso, utilizará softwares estatísticos e econométricos, além de diversas bases de dados.

2. EMENTA

Variáveis *dummy*; Variáveis instrumentais e mínimos quadrados em dois estágios; Modelos Probit e Logit; Modelos ARCH e GARCH; Modelos de séries temporais, regressão espúria e não-estacionariedade; Teste de estacionariedade com quebras; Modelos de vetores autorregressivos; Vetor de Correção de Erro (VEC) – Método de Johansen; Modelos ARDL – análise de cointegração; Estimação GMM – séries de tempo; Análise de painel (efeitos fixos e aleatórios); Análise de painel (GMM-DIFF e GMM-SYSTEM); Estudos empíricos: crescimento, indústria, desalinhamento e volatilidade cambial, e inflação regional (quebras).

3. PROGRAMA

1. Introdução: análise regressão, especificação e testes de diagnóstico
2. Variáveis *dummy*
3. Variáveis instrumentais e Mínimos Quadrados em Dois Estágios (2SLS)
4. Modelos Probit, Logit e Heckit
5. Modelos ARCH e GARCH
6. Modelos de séries temporais, regressão espúria e não-estacionariedade
7. Teste de estacionariedade com quebras
8. Modelos de vetores auto-regressivos (VAR)
9. VAR Estrutural (SVAR)
10. Vetor de correção de erro (VEC) – Método de Johansen
11. FMOLS, DOLS e CCR: Equação cointegrante
12. Modelos ARDL (séries de tempo) análise de cointegração e regressão do tipo *stepwise*
13. Estimação GMM (séries de tempo)
14. Análise de Painel (efeitos fixos, efeitos aleatórios, GMM-Diff E GMM-System)

15. Testes de raiz unitária e cointegração em painel (PEDRONI e KAO)

16. Estimação PMG (*POOLED MEAN GROUP*) ARDL

4. BIBLIOGRAFIA BÁSICA

ARELLANO, M. **Panel Data Econometrics: Advanced Texts in Econometrics**. Oxford University Press, 2003.

BALTAGI, B. H. **Econometric Analysis of Panel Data**. Wiley, Quarta Edição, 2008.

BAUM, C. F. **An Introduction to Modern Econometrics Using Stata**. Stata Press, 2007.

BECKETT, S. **Introduction to Time Series Using Stata**. Stata Press. 2013.

CAMERON, A. C.; TRIVEDI, P. K. **Microeconometrics Using Stata**. Stata Press, 2009.

DOUGHERTY, C. **Introduction to Econometrics**. Oxford University Press, Third Edition, 2007.

GUJARATI, D. **Econometria Básica**. Makron Books, 4^a ed., São Paulo, 2006.

MORETTIN, P. A.; TOLOI, C. M. C. **Análise de Séries Temporais**. Edgard Blucher LTDA, São Paulo, 2004.

WOOLDRIDGE, J. M. **Introdução à Econometria**. Editora Thomson, 4^a ed., 2011.

WOOLDRIDGE, J. M. **Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data**. MIT Press, 2002.

5. BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

ARELLANO, M.; BOND, S. Some Tests of Specification for Panel Data: Monte Carlo Evidence and an Application to Employment Equations. **Review of Economic Studies**, v. 58, n. 2, p. 277-297, 1991.

ARELLANO, M.; BOVER, O. Another Look at the Instrumental-Variable Estimation of Error-Components Models. **Journal of Econometrics**, v. 68, n. 1, p. 29-51, 1995.

BLUNDELL, R.; BOND, S. Initial conditions and moment restrictions in dynamic panel data models. **Journal of Econometrics**, v. 87, n. 1, p. 115-143, 1998.

BOND, S.; HOEFFLER, A.; TEMPLE, J. **GMM Estimation of Empirical Growth Models**. Economics Papers, Economics Group, Nuffield College, University of Oxforda, September, 2001.

ENDERS, W. **Applied Econometric Time Series**. John Wiley & Sons, New York, 1995.

ENGLE, R. F.; GRANGER, C. W. **J.Long-Run Economic Relationships: Readings in Cointegration**. Advanced Texts in Econometrics. Oxford University Press, Oxford, 1991.

HAMILTON, J. D. **Time Series Analysis**. Princeton University Press, 1994.

HARVEY, A. C. **The Econometric Analysis of Time Series**. MIT Press, 2^a ed., 1993.

HENDRY, D. **Dynamic Econometric: advanced texts in econometrics**. Oxford University Press, Oxford, 1994.

ROODMAN, D. A Note on the Theme of Too Many Instruments. **Oxford Bulletin of Economics and Statistics**, n. 71, p. 135-158, 2009.

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 10:27, 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 **5185993** e o código CRC **9B6B33E7**.