



FICHA DE COMPONENTE CURRICULAR

CÓDIGO: PECC1044	COMPONENTE CURRICULAR: Econometria I	
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 avançar nos estudos do campo da Econometria, apresentando a abordagem teórica referente aos principais métodos econométricos utilizados, assim como aplicações empíricas relacionadas a estes métodos. Fornecer ferramentas para aqueles que necessitam avançar em estudos e pesquisas que demandam algum estudo econométrico. O curso pressupõe conhecimentos básicos de matemática e estatística.

2. EMENTA

Modelo de Regressão Simples; Análise de Regressão Múltipla; Estimador de Mínimos Quadrados (MQO); Testes de Hipótese e Seleção do Modelo; Teste t; Teste de Wald; Teste F; Testes de Especificação; Forma Funcional e Mudança Estrutural; Endogeneidade e Estimação com Variável Instrumental; Modelo de Regressão Generalizado, Heterocedasticidade e Inferência Robusta; Sistema de Equações; Modelos de Equações Simultâneas; Correlação Serial e Estacionariedade; GMM.

3. PROGRAMA

1. Revisão de estatística e álgebra matricial
2. Modelo de regressão linear: hipóteses
3. Mínimos Quadrados Ordinários (MQO)
4. Testes de hipóteses e critérios de seleção do modelo
5. Forma funcional e mudança estrutural
6. Modelos e testes de quebras estruturais
7. Endogeneidade e estimação com variável instrumental
8. Modelo de regressão generalizada e heterocedasticidade
9. Sistema de Equações
10. Correlação serial e estacionariedade
11. Método Generalizado dos Momentos (GMM)

4. BIBLIOGRAFIA BÁSICA

GREENE, W. H. **Econometric Analysis**, 7^a ed., Prentice Hall, 2011.

BUENO, R. L. S. **Econometria de Séries Temporais**, 2^a ed., Cengage Learning, 2011.

WOOLDRIDGE, J. M. **Introdução à Econometria: Uma Abordagem Moderna**. Thomson Learning, 2006.

5. BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

ENDERS, W. **Applied Econometric Time Series**, 3^a ed., Wiley, 2009.

BUSSAB, W. O.; MORETTIN, P. A. **Estatística Básica**. 6^a ed., Saraiva, São Paulo, 2010

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 10:25, 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 Ramazini 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, informando o código verificador **5179321** e o código CRC **57D11715**.