



**PROGRAMA DE COMPONENTE CURRICULAR DO CURSO DE
BACHARELADO EM ESTATÍSTICA DA UFPB**

NOME DO COMPONENTE CURRICULAR		CRÉDITOS	CH TOTAL (h)
Econometria I		4	60
TIPO DE COMPONENTE		NATUREZA	DEPARTAMENTO
Disciplina		Optativa	Estatística
CH TEÓRICA (h)	CH PRÁTICA (h)	CH EAD (h)	CH EXTENSÃO (h)
60	0	0	0
EMENTA			
Testes dos pressupostos do modelo de regressão linear múltipla. Modelagem de variáveis qualitativas. Modelos de dados de painel. Modelos de Equações Simultâneas. Modelos ARCH e GARCH. Modelos Lineares Multivariados: ARMA e VAR. Teste de Raízes Unitárias e Cointegração.			
CONTEÚDO PROGRAMÁTICO			
1 TESTES DOS PRESSUPOSTOS DO MODELO DE REGRESSÃO LINEAR MÚLTIPLA 1.1 Regressão linear múltipla 1.2 Análise de resíduos 1.3 Multicolinearidade 1.4 Heterocedasticidade 1.5 Autocorrelação 1.6 Erros de especificação de modelos 2 MODELAGEM DE VARIÁVEIS QUALITATIVAS 2.1 Função Salário revista 2.2 Refinamento da função salário 2.3 Formas funcionais da regressão dos salários 2.4 Utilização de variáveis binárias na mudança estrutural 2.5 Utilização de variáveis binárias em dados sazonais 2.6 Função de vendas expandida 2.7 Regressão linear por partes 3 MODELOS DE DADOS DE PAINEL 3.1 A importância de dados em painel 3.2 Modelo de regressão MQO para dados empilhados de uma função de caridade 3.3 Modelo de mínimos quadrados com variáveis binárias para efeitos fixos (MQVD) 3.4 Limitações do modelo MQVD de efeitos fixos 3.5 O estimador de efeito fixo dentro do grupo (DG) 3.6 O modelo de efeitos aleatórios (MEA) 4 Modelos de Equações Simultâneas 4.1 Conceitos e Definições Básicas 4.2 Identificação do Modelo 4.3 Estimação de Parâmetros Estruturais			



DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA
CENTRO DE CIÊNCIAS EXATAS E DA NATUREZA
UNIVERSIDADE FEDERAL DA PARAÍBA



5 Modelos ARCH e GARCH

5.1 O modelo ARCH

5.2 O modelo GARCH

6 Modelos Lineares Multivariados

6.1 Conceitos e Definições Básicas

6.2 Identificação do Modelo

6.3 Estimação de Parâmetros

7 Modelos de cointegração e correção de erro

7.1 Fenômeno da regressão espúria

7.2 Simulação da regressão espúria

7.3 Testes de cointegração

7.4 Cointegração e mecanismo de correção de erro (MCE)

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

1. GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. **Econometria Básica**. Porto Alegre: AMGH, 2011. Disponível em: <<https://integrada.minhabiblioteca.com.br/reader/books/9788580550511>>. Minha Biblioteca.

2. GUJARATI, D. N. **Econometria: princípios, teoria e aplicações práticas**. São Paulo: Saraiva Educação, 2019. Disponível em: <<https://integrada.minhabiblioteca.com.br/reader/books/9788553131952>>. Minha Biblioteca.

3. MURTEIRA, J.; CASTRO, V. **Introdução à econometria**. Coimbra: Almedina, 2018. Disponível em: <<https://integrada.minhabiblioteca.com.br/reader/books/9789724074429>>. Minha Biblioteca.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

1. MURTEIRA, J.; CASTRO, V. **Introdução à econometria: exercícios resolvidos**. Coimbra: Almedina, 2018. Disponível em: <<https://integrada.minhabiblioteca.com.br/reader/books/9789724074436>>. Minha Biblioteca.

2. HEISS, F. **Using R for Introductory Econometrics**. [S.l.]: Createspace Independent Publishing Platform, 2016. Disponível em: <<http://www.urfie.net/read/index.html>>. Online.

3. ROSSI, J. W. NEVES, C. **Econometria e séries temporais com aplicações a dados da economia brasileira**. Rio de Janeiro: LTC, 2014. Disponível em: <<https://integrada.minhabiblioteca.com.br/books/978-85-216-2685-5>>. Minha Biblioteca.

4. TURNER, P. **Econometrics in Practice**. Bloomfield: Mercury Learning & Information, 2021. Disponível em: <<https://ebookcentral.proquest.com/lib/bcufpb-ebooks/detail.action?docID=6647709>>. ProQuest Ebook Central.

5. BALTAGI, B. H. **A Companion to Theoretical Econometrics**. Chichester: John Wiley & Sons, Incorporated, 2001. Disponível em: <<https://ebookcentral.proquest.com/lib/bcufpb-ebooks/detail.action?docID=350897>>. ProQuest Ebook Central.