



**UNIVERSIDADE FEDERAL DE PERNAMBUCO**  
**PRÓ-REITORIA PARA ASSUNTOS ACADÊMICOS**  
**DIRETORIA DE DESENVOLVIMENTO DO ENSINO**

**PROGRAMA DE COMPONENTE CURRICULAR**

**TIPO DE COMPONENTE (Marque um X na opção)**

☒ Disciplina  
☐ Atividade complementar  
☐ Trabalho de Conclusão de Curso - TCC

☐ Prática de Ensino  
☐ Módulo  
☐ Trabalho de Graduação

**STATUS DO COMPONENTE (Marque um X na opção)**

☒ OBRIGATÓRIO

☐ ELETIVO

☐ OPTATIVO

**DADOS DO COMPONENTE**

Código	Nome	Carga Horária Semanal		Nº. de Créditos	C. H. Global	Período
		Teórica	Prática			
ECON 00XX	Econometria	4	0	4	60	5º

Pré-requisitos	ESTATÍSTICA ECONÔMICA E INTRODUÇÃO À ECONOMETRIA	Co-Requisitos		Requisitos C.H.	
----------------	--	---------------	--	-----------------	--

**EMENTA**

Modelo linear generalizado. Quebra das importes estruturais: autocorrelação, heterocedasticidade e multicolinearidade. Transformação de Box-Cox. Regressão não-linear. Regressão de variáveis qualitativas. Séries temporais.

**OBJETIVO(S) DO COMPONENTE**

**GERAL:**

Desenvolver habilidades que permitam ao estudante o uso de modelos econométricos.

**ESPECÍFICOS:**

- Estudar o Modelo de Mínimos Quadrados e o Teorema de Gauss Markov;
- Fornecer subsídios para aplicação de modelos de regressão composta;
- Preparar o aluno para utilizar pacotes econométricos mais avançados, principalmente o SPSS.

**METODOLOGIA**

Aulas expositivas, utilizando-se o quadro, retroprojektor ou data-show. Exercícios em sala e corrigidos.

**AValiação**

Avaliação constante do desenvolvimento do conhecimento do aluno e duas avaliações formais.

**CONTEÚDO PROGRAMÁTICO**

1. Modelo econométricos
  - 1.1. Objetivos;
  - 1.2. Construção;
  - 1.3. Importância no processo da construção do conhecimento;
  - 1.4. Tipos de variáveis;
  - 1.5. Tipos de dados.
2. Modelo linear com k variáveis.
  - 2.1. Formulação algébrica dos mínimos quadrados – MMQ;
  - 2.2. Equação na forma de desvio
  - 2.3. Geometria dos MMQ
3. Inferência na equação com k variáveis;
4. Teorema de Gauss-Markov
5. Quebra dos pressupostos
  - 5.1. Multicolinearidade
  - 5.2. Heterocedasticidade
  - 5.3. Autocorrelação
6. Regressão não-linear
- 6.1. Estimador de máxima verossimilhança.
7. Transformação Box-Cox.
8. Regressão com variáveis qualitativas.
9. Séries temporais.

#### BIBLIOGRAFIA BÁSICA

GUJARATI, D. *Econometria Básica*. Rio de Janeiro: Campus, 2006.  
 JOHNSTON, J. & DINARDO, J. *Métodos Econométricos*. Lisboa: McGraw Hill, 2001.  
 PINDYCK, R.S.; RUBINFELD, D. L. *Econometria*. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004.

#### BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

MADDALA, G.S. *Introdução à Econometria*. Rio de Janeiro: LTC-Livros Técnicos e Científicos Editora S.A., 2003.

DEPARTAMENTO A QUE PERTENCE O COMPONENTE

**NÚCLEO DE GESTÃO**

ASSINATURA DO CHEFE DO NÚCLEO

*Maria Rodrigues dos Anjos*  
 Coordenadora do Núcleo de Gestão  
 UFPE CAA

HOMOLOGADO PELO COLEGIADO DE CURSO

**ECONOMIA**

ASSINATURA DO COORDENADOR DO CURSO OU ÁREA



Pro<sup>fa</sup> Lucilena F. Castanheira Corrêa  
 SIAPE Nº1796244  
 Coordenadora do Curso de  
 Ciências Econômicas  
 UFPE/CAA