

**UNIVERSIDADE FEDERAL DE UBERLÂNDIA**  
**FACULDADE DE GESTÃO E NEGÓCIOS**  
**PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ADMINISTRAÇÃO**

**FICHA DE DISCIPLINA**

<b>Disciplina:</b>	Econometria		
<b>Código:</b>	FAGEN41067	<b>Área de concentração:</b>	Regionalidade e Gestão
<b>Linha(s) de pesquisa:</b>	<input checked="" type="checkbox"/> Gestão Organizacional e Regionalidade <input type="checkbox"/> Sociedade, Desenvolvimento e Regionalidade		
<b>Nível:</b>	<input checked="" type="checkbox"/> Mestrado <input checked="" type="checkbox"/> Doutorado		
<b>Tipo:</b>	<input type="checkbox"/> Obrigatória <input checked="" type="checkbox"/> Eletiva		
<b>Créditos:</b>	4	<b>Carga horária:</b>	60

**Objetivo da disciplina:**

O presente curso de econometria visa introduzir aos alunos os principais conceitos, modelos, testes e aplicações econométricas. A parte teórica do programa incorpora a análise de regressão múltipla e as violações das hipóteses do MCRL, especialmente a ocorrência de autocorrelação e heterocedasticidade. Além disso, outros tópicos de econometria serão desenvolvidos, incluindo variáveis dummy e análise de séries temporais. Uma atenção especial será dada à análise de dados em painel (efeito fixo e efeito aleatório). Finalmente, o curso pretende também desenvolver uma análise dos chamados modelos de variável dependente binária (probit e logit).

**Ementa:**

1. Modelo de Regressão com duas variáveis (Regressão simples).
2. Regressão Múltipla.
3. Testes de Hipóteses.
4. Multicolinariedade, Heteroscedasticidade e Autocorrelação.
5. Variáveis Dummy.
6. Modelo PROBIT e LOGIT.
7. Séries Temporais.
8. Regressão com Dados em Painel.

**Referências bibliográficas:**

### Básica:

GUJARATI, D; PORTER, D. C. **Econometria básica**. 5. ed. Porto Alegre: McGraw Hill, 2011.

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

WOOLDRIDGE, J. M. **Introdução à econometria: uma abordagem moderna**. Tradução da 7ª Edição Norte Americana. 4. ed. São Paulo: Cengage Learning, 2023.

### Complementar:

ARELLANO, Manuel; BOND, Stephen. Some tests of specification for panel data: Monte Carlo evidence and an application to employment equations. **The review of economic studies**, v. 58, n. 2, p. 277-297, 1991.

BAUM, Christopher F. **An introduction to modern econometrics using Stata**. Stata press, 2006.

BOND, Stephen R.; HOEFFLER, Anke; TEMPLE, Jonathan RW. GMM estimation of empirical growth models. **Available at SSRN 290522**, 2001.

CAMERON, A. C.; TRIVEDI, P. K. **Microeconometrics using Stata**. Texas: Stata Press, 2009.

CLEMENTE, Jesus; MONTAÑÉS, Antonio; REYES, Marcelo. Testing for a unit root in variables with a double change in the mean. **Economics letters**, v. 59, n. 2, p. 175-182, 1998.

FAVERO, L. P. L. Dados em painel em contabilidade e finanças: teoria e prática. **Brazilian Business Review**, v. 10, n. 1, jan-mar. 2013.

HAUSMAN, J. Specification test in econometrics. **Econometrica**, v. 46, p.1251-1271, 1978.

HILL, R. C.; GRIFFITHS, W. E.; JUDGE, G. G. **Econometria**. 3. Ed. São Paulo: Saraiva, 2010.

LONG, J. S; FREESE, J. **Regression models for categorical dependent variables using stata**. Texas: Stata Press, 2006.

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

STOCK, J. H.; WATSON, M. W. **Econometria**. São Paulo: Addison Wesley, 2004.

WHITE, H. A heteroskedasticity-consistent covariance matrix estimator and a direct test for heteroskedasticity. **Econometrica**, v. 48, p.817-838, 1980.