

Anexo II – Resolução nº 133/2003-CCSA

UNIVERSIDADE ESTADUAL DO OESTE DO PARANÁ
PRÓ-REITORIA DE PESQUISA E PÓS-GRADUAÇÃO

PLANO DE ENSINO - PERÍODO LETIVO/ANO 1º/2019

Programa de Pós-Graduação em Economia *Stricto Sensu* – Nível de Mestrado

Área de Concentração: Teoria Econômica

Mestrado (X) Doutorado ()

Centro de Ciências Sociais Aplicadas

Campus de Toledo

DISCIPLINA

Código	Nome	Carga horária		
		AT ¹	AP ²	Total
	Econometria I			60 h/a

(¹ Aula Teórica; ² Aula Prática)

Ementa

Apresentação de conceitos e instrumentos necessários para a compreensão da econometria, inclusive álgebra matricial; Análise das hipóteses básicas do modelo de regressão, seus possíveis problemas e soluções; Uso da variável *dummy*; Equações simultâneas; Modelos logarítmicos; Apresentação de métodos alternativos de análises empíricas; Aplicações econométricas práticas.

Objetivos

Dotar o aluno de instrumental econométrico que possibilite o tratamento dos dados econômicos de forma a comprovar empiricamente as relações intrínsecas aos diferentes modelos econômicos.

Conteúdo Programático

1. Introdução
 - 1.1. Modelos Econométricos
 - 1.2. Dados Econômicos
2. Revisão: O Modelo de Regressão Múltipla
 - 2.1. Modelo de Regressão Linear Generalizado (MQG)
3. Violação dos Pressupostos Básicos
 - 3.1. Multicolinearidade
 - 3.2. Heterocedasticidade
 - 3.3. Erros Autocorrelacionados/Correlação Serial
4. Econometria de Séries Temporais
 - 4.1. Conceitos Básicos de Séries Temporais (Estacionariedade)
 - 4.2. Modelos ARIMA de Box & Jenkins (rápida apresentação)
 - 4.3. Estacionariedade, Raízes Unitárias e Cointegração
5. Modelagem Econométrica
 - 5.1. Especificação do Modelo e diagnósticos (erros de especificação)
 - 5.2. Modelos de regressão não lineares (rápida apresentação)
6. Modelos de Escolha Qualitativa: Probit e Logit
7. Modelos de Regressão com Dados em Painel
8. Modelos Auto-regressivos e Defasagem Distribuída

Metodologia

O conteúdo programático será desenvolvido a partir de aulas expositivas, cabendo ao aluno a leitura da bibliografia mínima exigida e aulas práticas para aprendizado de programa estatístico no laboratório de informática com utilização do Software Eview's.

Avaliação

(critérios, mecanismos, instrumentos e periodicidade)

Duas provas com peso 6 e trabalho a ser apresentado no final do curso com peso 4.

Bibliografia básica

- GREENE, William H.. Econometric analysis. 6th.ed. Saddle River, NJ: Pearson Prentice Hall, 2008. 1178p.
- GUJARATI, Damodar N. Econometria básica. Rio de Janeiro: Elsevier
- HILL, Carter; GRIFFITHS, William; JUDGE, George. Econometria. São Paulo. Editora Saraiva.
- JOHNSTON, J. e DINARDO, J. Econometric methods. 4th Edition. McGraw-Hill
- MADALA,G.S.; Introdução à econometria. Rio de Janeiro. LTC.
- PINDYCK, John.E. RUBINFELD, Daniel.L. Econometria: modelos e previsões. Rio de Janeiro: Elsevier
- Wooldridge, Jeffrey M.. Introdução à econometria: uma abordagem moderna. Rogério César de Souza; José Antônio Ferreira (trad.). São Paulo: Thomson Learning, 2006. 684 p.

Bibliografia complementar

HOFFMANN, Rodolfo; VIEIRA, Sônia. Análise de regressão: uma introdução à econometria. São Paulo. HUCITEC.
HOFFMAN,R. Estatística para economistas. São Paulo, Pioneira
KMENTA, Jan. **Elementos de Econometria**: teoria estatística básica. Tradução de Carlos Roberto Vieira de Araújo. São Paulo. Editora Atlas.
VASCONCELOS, Marco A. Sandoval; ALVES, Denisard. Coord. Manual de econometria. Equipe de professores da USP. São Paulo. Editora Atlas.

Docente

Luiz Alberto Cypriano

Data 19/11/2018

Assinatura dos docentes responsáveis pela disciplina

Colegiado do Programa (aprovação)

Ata nº , de / / .
Coordenador:

assinatura

Conselho de Centro (homologação)

Ata de nº , de / /
Diretor de Centro:

assinatura

Encaminhada cópia à Secretaria Acadêmica em: / / .

Nome/assinatura