

**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 <sup>1</sup>	AP <sup>2</sup>	Total
	<b>Econometria I</b>			<b>60 h/a</b>

(<sup>1</sup> Aula Teórica; <sup>2</sup> 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