

Ficha 2

Disciplina: ECONOMETRIA II								Código: SE 618	
Natureza: (x) Obrigatória () Optativa			(x) Semestral () Anual			Pré-requisito: SE614	Nº total vagas:		
CH Total: 60 CH semanal: 4	Padrão (PD): 30	Laboratório (LB): 30	Campo (CP): 0	Estágio (ES): 0	Orientada (OR): 0	Prática Específica (PE): 0	Estágio de Formação Pedagógica (EFP):		
Ementa (Unidade Didática)									
Modelos de variáveis binárias. Modelos autoregressivos e de defasagens distribuídas. Equações Simultâneas. Processos estacionários. Processos não-estacionários. Cointegração.									
Justificativa para a oferta a distância									
Essa é uma disciplina obrigatória para o Curso de Ciências Econômicas.									
Objetivos (Geral e Específicos)									
Capacitar o aluno para compreender e aplicar os principais conceitos de Econometria.									
Programa (itens de cada unidade didática)									
A disciplina terá carga horária semanal de 04 horas/aula e o curso será ministrado em 15 semanas para atender às 60 horas/aula.									
Data de Início: 18/10/2022									
Data de Término: 24/02/2023 (término das aulas)									
Semanas	Data	Aula/Atividade/Etc.			Tempo dedicado à atividade (em horas)	Referências			
1	18/10/2022 (terça-feira)	Aula 1: Apresentação do programa e do planejamento da disciplina; revisão de conceitos já estudados de econometria I.			2,0	SARTORIS, Cap. 8 até 8.7			
	21/10/2022 (sexta-feira)	Aula 2: Revisão de Conceitos já estudados em econometria I. Lista de Exercícios 1			2,0	SARTORIS, Cap. 9			
2	25/10/2022 (terça-feira)	Aula 3: Modelos de Variáveis Binárias (1).			2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 9			
	28/10/2022 (sexta-feira)	Aula 4: Modelos de Variáveis Binárias (2). Lista de Exercícios 2			2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 9			
3	01/11/2022 (terça-feira)	Aula 5: Modelo de regressão de resposta qualitativa (1)			2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 15			

	04/11/2022 (sexta-feira)	Aula 6: Modelo de regressão de resposta qualitativa (2) Lista de Exercícios 3	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 15
4	08/11/2022 (terça-feira)	Aula 7: Modelo de regressão de resposta qualitativa (3)	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 15
	11/11/2022 (sexta-feira)	Aula 8: Modelo de regressão de resposta qualitativa (4) Lista de Exercícios 4	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 15
5	18/11/2022 (sexta-feira)	Aula 9: Modelos autorregressivos (1). Lista de Exercícios 5	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 17
	22/11/2022 (terça-feira)	Aula 10: Modelos autorregressivos (2).	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 17
6	25/11/2022 (sexta-feira)	Aula 11: Modelos com defasagens distribuídas (1) Lista de Exercícios 6	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 17
	29/11/2022 (terça-feira)	Aula 12: Modelos com defasagens distribuídas (2)	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 17
7	02/12/2022 (sexta-feira)	Aula 13: Modelos de equações simultâneas (1). Lista de Exercícios 7	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 18
	06/12/2022 (terça-feira)	Aula 14: Modelos de equações simultâneas (2).	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 18
8	09/12/2022 (sexta-feira)	Aula 15: O Problema da Identificação Lista de Exercícios 8	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 19
	13/12/2022 (terça-feira)	Aula 16: Exercícios	2,0	
9	16/12/2022 (sexta-feira)	Aula 17: PROVA 1	2,0	
	20/12/2022 (terça-feira)	Aula 18: Regressão Básica Com Dados de Séries Temporais	2,0	WOOLDRIDGE, Cap. 10
10	23/12/2022 (sexta-feira)	Aula 19: Inferência Sob as Hipóteses do Modelo Linear Clássico Lista de Exercícios 9	2,0	WOOLDRIDGE, Cap. 10
	17/01/2023 (terça-feira)	Aula 20: Econometria de Séries Temporais	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 21

11	20/01/2023 (sexta-feira)	Aula 21: Estacionariedade e não estacionariedade Lista de Exercícios 10	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 21
	24/01/2023 (terça-feira)	Aula 22: Teste de Estacionariedade	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 21
12	27/01/2023 (sexta-feira)	Aula 23: Cointegração Lista de Exercícios 11	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 21
	31/01/2023 (terça-feira)	Aula 24: Introdução à Econometria de Séries Temporais: Previsão	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 22
13	03/02/2023 (sexta-feira)	Aula 25: Previsão em Séries Temporais: tipos de modelos Lista de Exercícios 12	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 22.
	07/02/2023 (terça-feira)	Aula 26: Previsão em Séries Temporais: Modelos ARIMA (1)	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 22
14	10/02/2023 (sexta-feira)	Aula 27: Previsão em Séries Temporais: Modelos ARIMA (2) Lista de Exercícios 13	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 22
	14/02/2023 (terça-feira)	Aula 28: Exercícios	2,0	.
15	17/02/2023 (sexta-feira)	Aula 29: PROVA 2 (conteúdo da disciplina)	2,0	
	24/02/2023 (sexta-feira)	Aula 30: Debate a respeito do conteúdo.	2,0	-
	Carga horária total da disciplina	-	60,0	-
	03/03/2023 (sexta-feira)	Exame final		-

PROCEDIMENTOS DIDÁTICOS

O curso será ministrado através de aulas presenciais que trabalharão tanto conteúdo teórico, como aplicação e análise de regressões estimadas e o uso do Software R na econometria.

Avaliações:

O aluno responderá 13 listas semanais de exercícios (peso de 20% da nota da disciplina).

1ª. Avaliação (16/12/2022): Prova 1 (peso de 40% da nota da disciplina).

2ª. Avaliação (17/02/2023): Prova 2 (peso de 40% da nota da disciplina).

Para acompanhar o curso os alunos deverão ter acesso, via computador, à UFPR Virtual e ao R-StudioCloud (<https://rstudio.cloud>). Opcionalmente, para o software R, pode-se utilizar um computador com os seguintes softwares instalados (open-source):

- R, disponível em: <https://cran.r-project.org/>;
- R-Studio (Desktop), disponível em: <https://rstudio.com/products/rstudio/> (instalar primeiro o R e em seguida o R-Studio).

FORMAS DE AVALIAÇÃO

Tipos de avaliação	Datas previstas	Pontuação
Lista de exercícios proposta pela professora usando o conteúdo estudado nas semanas , disponibilizadas na plataforma UFPR Virtual no primeiro dia útil da semana	Até o domingo da semana	20%
Prova 1	16/12/2022	40%
Prova 2	17/02/2023	40%
Exame final	03/03/2023	

IMPORTANTE:

O prazo final de entrega das listas semanais ocorre às 23:59h do domingo. Apesar da professora recomendar que os alunos entreguem as listas de exercício durante os dias normais de aula, de forma a poderem usufruir do final de semana de descanso, o prazo de entrega final foi estabelecido para o domingo em função de pedidos dos alunos nas disciplinas já ministradas, particularmente daqueles que trabalham e que acabam utilizando também o final de semana para as atividades acadêmicas.

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. **Econometria básica**. 5. ed. Porto Alegre: AMGH, 2011. Disponível em: <https://minhabiblioteca.ufpr.br/biblioteca/>

WOOLDRIDGE, J. **Introdução à Econometria: uma abordagem moderna**. São Paulo: Cengage, 2018.

MORETTIN, P.; TOLLOI, C. **Análise de Séries Temporais**. 2. ed. São Paulo: Editora Blucher, 2006.

SARTORIS, A. **Estatística e Introdução à Econometria**. Saraiva, 2004. Disponível em: <https://minhabiblioteca.ufpr.br/biblioteca/>

VALE, V. A **Introdução ao R – NEDUR**. Disponível em: <https://viniciusvale.github.io/NEDUR/Intro-R.html>

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

BUENO, R. L.S. **Econometria de séries temporais**. 2. Ed. São Paulo: Cengage, 2011.

Professor(a) proponente da Disciplina: Adriana Sbicca Fernandes
E-mail do(a) Professor(a): adsbicca@ufpr.br