



UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARANÁ
DEPARTAMENTO DE ECONOMIA

Av Prefeito Lothário Meissner, 632, Terreo - Bairro Jardim Botânico, Curitiba/PR,
CEP 80210-170

Telefone: (41)3360-4356 - <http://www.ufpr.br/>

Despacho nº 5641418/2023/UFPR/R/SA/DEPECON

Processo nº 23075.029095/2023-70

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) Capacitar o aluno para compreender e aplicar os principais conceitos de Econometria. Objetivos (Específicos) Compreender trabalhos científicos e relatórios com utilização de modelos de séries temporais. Desenvolver modelos de séries temporais. Adotar modelos de séries temporais para análise empírica.							

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: 26/07/2023

Data de Término: 06/11/2023 (término das aulas)

Semanas	Data	Aula/Atividade/Etc.	Tempo dedicado à atividade (em horas)	Referências
1	26/07/2023 (quarta-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
	31/07/2023 (segunda-feira)	Aula 2: Revisão de Conceitos já estudados em econometria I. Lista de Exercícios 1	2,0	SARTORIS, Cap. 9
2	02/08/2023 (quarta-feira)	Aula 3: Modelos de Variáveis Binárias (1).	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 9
	07/08/2023 (segunda-feira)	Aula 4: Modelos de Variáveis Binárias (2). Lista de Exercícios 2	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 9
3	09/08/2023 (quarta-feira)	Aula 5: Modelo de regressão de resposta qualitativa (1)	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 15
	14/08/2023 (segunda-feira)	Aula 6: Modelo de regressão de resposta qualitativa (2) Lista de Exercícios 3	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 15
4	16/08/2023 (quarta-feira)	Aula 7: Modelo de regressão de resposta qualitativa (3)	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 15
	21/08/2023 (segunda-feira)	Aula 8: Modelo de regressão de resposta qualitativa (4) Lista de Exercícios 4	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 15
5	23/08/2023 (quarta-feira)	Aula 9: Modelos autorregressivos (1). Lista de Exercícios 5	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 17
	28/08/2023 (segunda-feira)	Aula 10: Modelos autorregressivos (2).	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 17
6	30/08/2023 (quarta-feira)	Aula 11: Modelos com defasagens distribuídas (1) Lista de Exercícios 6	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 17
	04/09/2023 (segunda-feira)	Aula 12: Modelos com defasagens distribuídas (2)	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 17
7	06/09/2023 (quarta-feira)	Aula 13: Modelos de equações simultâneas (1). Lista de Exercícios 7	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 18

	11/09/2023 (segunda-feira)	Aula 14: Modelos de equações simultâneas (2).	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 18
8	13/09/2023 (quarta-feira)	Aula 15: O Problema da Identificação Lista de Exercícios 8	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 19
	18/09/2023 (segunda-feira)	Aula 16: Exercícios	2,0	
9	20/09/2023 (quarta-feira)	Aula 17: PROVA 1	2,0	
	25/09/2023 (segunda-feira)	Aula 18: Regressão Básica Com Dados de Séries Temporais	2,0	WOOLDRIDGE, Cap. 10
10	27/09/2023 (quarta-feira)	Aula 19: Inferência Sob as Hipóteses do Modelo Linear Clássico Lista de Exercícios 9	2,0	WOOLDRIDGE, Cap. 10
	02/10/2023 (segunda-feira)	Aula 20: Econometria de Séries Temporais	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 21
11	04/10/2023 (quarta-feira)	Aula 21: Estacionariedade e não estacionariedade Lista de Exercícios 10	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 21
	09/10/2023 (segunda-feira)	Aula 22: Teste de Estacionariedade	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 21
12	11/10/2023 (quarta-feira)	Aula 23: Cointegração Lista de Exercícios 11	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 21
	16/10/2023 (segunda-feira)	Aula 24: Introdução à Econometria de Séries Temporais	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 22
13	18/10/2023 (quarta-feira)	Aula 25: Introdução à Econometria de Séries Temporais: Previsão Lista de Exercícios 12	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 22.
	23/10/2023 (segunda-feira)	Aula 26: Previsão em Séries Temporais: tipos de modelos	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 22
14	25/10/2023 (quarta-feira)	Aula 27: Previsão em Séries Temporais: Modelos ARIMA (1) Lista de Exercícios 13	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 22
	30/10/2023 (segunda-feira)	Aula 28: Previsão em Séries Temporais: Modelos ARIMA (2)	2,0	GUJARATI e PORTER, Cap. 22
15	01/11/2023 (quarta-feira)	Aula 29: Exercícios	2,0	
	06/11/2023 (segunda-feira)	Aula 30: PROVA 2 (conteúdo da disciplina)	2,0	-

	Carga horária total da disciplina	-	60,0	-
	04/12/2023 (segunda-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 (20/09/2023): Prova 1 (peso de 40% da nota da disciplina).

2ª. Avaliação (06/11/2023): 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	20/09/2023	40%
Prova 2	06/11/2023	40%
Exame final	04/12/2023	

IMPORTANTE:

As listas de exercícios são disponibilizadas na segunda-feira da semana. 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.
SARTORIS, A. **Estatística e Introdução à Econometria**. Saraiva, 2004. Disponível em: <https://minhabiblioteca.ufpr.br/biblioteca/>

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

BUENO, R. L.S. Econometria de séries temporais. 2. Ed. São Paulo: Cengage, 2011.
GRIFFITHS, W. E.; HILL, R. C. & JUDGE, G. G. Econometria. 3. ed. São Paulo: Editora Saraiva, 2003.
HOFFMANN, R & VIEIRA, S. Análise de Regressão. 2. ed. São Paulo: Hucitec, 1987.
MORETTIN, P.; TOLLOI, C. Análise de Séries Temporais. 2. ed. São Paulo: Editora Blucher, 2006.
PINDYCK, R.S.; RUBINFELD, D.L. Econometria. Rio de Janeiro: Editora Campus, 2004.
VALE, V. A Introdução ao R – NEDUR. Disponível em: <https://viniciusvale.github.io/NEDUR/Intro-R.html>

Professor(a) proponente da Disciplina: Adriana Sbicca Fernandes

E-mail do(a) Professor(a): adsbicca@ufpr.br



Documento assinado eletronicamente por **ADRIANA SBICCA FERNANDES, PROFESSOR DO MAGISTERIO SUPERIOR**, em 05/06/2023, às 21:25, conforme art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006.



A autenticidade do documento pode ser conferida [aqui](#) informando o código verificador **5641418** e o código CRC **71AA1085**.