



UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARANÁ

INFORMAÇÃO Nº 180/2022/UFPR/R/SA/DEPECON

PROGRAMA DA DISCIPLINA DE TÓPICOS ESPECIAIS EM ECONOMETRIA - CÓDIGO SE354

Pré-requisito: SE308 - Econometria

Carga horária: 60 (sessenta) horas

Créditos: 04 (quatro)

Natureza: semestral

EMENTA

- “ Análise exploratória de séries temporais econômicas.
- “ Modelos de séries econômicas univariadas e multivariadas.
- “ Modelos de séries temporais não lineares.
- “ Modelos ARIMA, GARCH.
- “ Mudanças de sazonalidade e observações aberrantes.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

1. Modelagem econométrica: especificação de modelo e diagnósticos.

- 1.1 Critérios de seleção de modelos;
- 1.2 Tipos e conseqüências de erros de especificação do modelo;
- 1.3. Detecção dos erros de especificação;
- 1.4 Erros de medição;
- 1.5 Especificação incorreta do termo de erro estocástico;
- 1.6 Modelos aninhados vs. não aninhados;
- 1.7 Testes de hipóteses não aninhadas;
- 1.8 Critérios para seleção de modelos;
- 1.9 Tópicos adicionais sobre modelagem econométrica.

2. Modelos de regressão não lineares.

- 2.1 Modelos de regressão intrinsecamente lineares e não lineares;
- 2.2 Estimação dos modelos de regressão lineares e não lineares;

2.3 Estimação dos modelos de regressão não lineares: o método da tentativa e do erro;

2.4 Algoritmos para a estimação de modelos de regressão não lineares.

3. Modelos de escolha qualitativa.

3.1 A natureza dos modelos de escolha qualitativa;

3.2 O modelo de probabilidade linear e suas aplicações;

3.3 Alternativas ao modelo de probabilidade linear;

3.4 O modelo logit e sua estimação;

3.5 O modelo logit agrupado (GLOGIT);

3.6 O modelo logit para dados não agrupados ou individuais;

3.7 O modelo probit;

3.8 Os modelo logit e probit;

3.9 O modelo tobit;

3.10 Modelagem de dados contáveis: o modelo de regressão de poisson.

4. Modelos de regressão com dados em painel.

4.1 Por que dados em painel?

4.2 Estimação de modelos de regressão com dados em painel: a abordagem dos efeitos fixos;

4.3 Estimação de modelos de regressão com dados em painel: a abordagem dos efeitos aleatórios;

4.4 Os modelos de efeitos fixos vs. os de efeitos aleatórios;

4.5 Regressões com dados em painel: alguns comentários finais.

5. Modelos econométricos dinâmicos: modelos auto-regressivos e com defasagens distribuídas.

5.1 O papel do tempo ou da defasagem na economia;

5.2 A razão das defasagens;

5.3 Estimação dos modelos de defasagem distribuídas;

5.4 A abordagem de Koyck aos modelos de defasagens distribuídas;

5.5 Racionalização do modelo de Koyck: o modelo de expectativas adaptativas;

5.6 Outra justificativa do modelo de Koyck: o modelo de ajustamento de estoques ou de ajustamento parcial;

5.7 Combinação de modelos de expectativas adaptativas e de ajustamento parcial;

5.8 Estimação de modelos auto-regressivos;

5.9 O métodos das variáveis instrumentais;

5.10 Detecção da autocorrelação nos modelos auto-regressivos: o teste h de Durbin;

5.11 A abordagem de Almon aos modelos de defasagens distribuídas;

5.12 Causalidade em economia: o teste de causalidade de Granger.

6. Modelos de equações simultâneas.

6.1 A natureza dos modelos de equações simultâneas;

6.2 O viés das equações simultâneas: inconsistência dos estimadores de MQO;

6.3 O viés das equações simultâneas: um exemplo numérico;

6.4 O problema da identificação;

6.5 Regras para identificação;

6.6 Um teste de simultaneidade;

6.7 Testes de exogeneidade.

7. Métodos de equações simultâneas.

7.1 Abordagens da estimação;

7.2 Modelos recursivos e mínimos quadrados ordinários;

7.3 Estimação de uma equação exatamente identificada: o método dos mínimos quadrados indiretos (MQI);

7.4 Estimação de uma equação superidentificada: o método dos mínimos quadrados de dois estágios (MQ2E).

8. Econometria de séries **temporais**: alguns conceitos básicos.

8.1 Exames de algumas séries temporais da economia dos Estados Unidos e alguns conceitos-chave;

8.2 Processos estocásticos;

8.3 Processo estocástico de raiz unitária;

8.4 Processos estocásticos de tendência estacionária e estacionários em diferença;

8.5 Processos estocásticos integrados;

8.6 O fenômeno da regressão espúria;

8.7 Testes de estacionariedade;

8.8 O teste da raiz unitária;

8.9 Transformação de séries temporais não estacionárias;

8.10 Co-integração.

9. Econometria de séries temporais: previsão.

9.1 Abordagens à previsão econômica;

9.2 Modelagem de séries temporais segundo os métodos auto-regressivo, das médias móveis e ARIMA;

9.3 O método Box-Jenkins;

9.4 Identificação;

9.5 Estimação do modelo ARIMA;

9.6 Testes para diagnóstico;

9.7 Previsões;

9.8 Outros aspectos do método Box-Jenkins;

9.9 Auto-regressão vetorial (VAR);

9.10 Medindo a volatilidade em séries temporais financeiras: os modelos ARCH e GARCH.

BIBLIOGRÁFICA

GUJARATI, D. Econometria básica. Editora Makron Books, 4a edição, 2006.

HILL, R. C.; GRIFFITHS, W. E. & JUDGE, G. G. Econometria. Editora Saraiva. 2006, 2a edição.

HOFFMAN, R. Estatística para Economistas. Editora Pioneira. 2ª edição. São Paulo. 1991.

HOFFMANN, R & VIEIRA, S. Análise de Regressão. Ed. Hucitec. 2ª. edição. São Paulo. 1987.

MADDALA, G. Introdução à Econometria. Ed. Prentice-Hall. 3ª edição. 2001.

MATOS, O. C. Econometria Básica. Atlas. 2ª edição. 1997.

Departamento de Economia do Setor de Ciências Sociais Aplicadas da Universidade Federal do Paraná.
Confere com o original.

Curitiba, 04 de abril de 2022.



Documento assinado eletronicamente por **JOSE GUILHERME SILVA VIEIRA, CHEFE DO DEPARTAMENTO DE ECONOMIA - SA**, em 05/04/2022, às 11:27, conforme art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006.



A autenticidade do documento pode ser conferida [aqui](#) informando o código verificador **4394040** e o código CRC **B8771A48**.