



UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARANÁ

INFORMAÇÃO Nº 318/2022/UFPR/R/SA/DEPECON

PROGRAMA DA DISCIPLINA DE ECONOMETRIA I - CÓDIGO SE025

Pré-requisito: Estatística Econômica e Introdução à Econometria I – SE054

Carga horária: 60 (sessenta) horas

Créditos: 04 (quatro)

Natureza: semestral

EMENTA

Problemas metodológicos.

Econometria e Estatística.

Econometria Aplicada.

PROGRAMA

1. Introdução à Econometria.

1.1. Conceitos e Objetivos.

1.2. Modelos.

1.3. Especificação de Modelos Econométricos.

2. Notação Matricial.

2.1. Matrizes inversa, transposta, identidade, simétrica.

2.2. Álgebra matricial.

3. Análise de Regressão Linear Múltipla.

3.1. O Modelo Estatístico de uma Regressão Linear Múltipla.

3.2. Estimativas dos Parâmetros por M. Q. O.

3.3. Variâncias e Covariâncias.

3.4. Variância de uma Combinação Linear das Estimativas dos Parâmetros.

3.5. Análise de Variância.

3.6. Previsão e Teste de Hipóteses para Combinações Lineares dos Parâmetros.

3.7. Intervalos de Confiança.

3.8. Coeficientes de Correlação Parcial.

4. Problemas com os Pressupostos Econométricos Básicos.

4.1. Autocorrelação nos Resíduos.

4.2. Multicolinearidade.

4.3. Heterocedasticia.

5. Utilização de Variáveis Binárias.

6. Erros nas Variáveis Independentes e Variáveis Defasadas.

6.1. Introdução.

6.2. Utilização de Variáveis Instrumentais para Obter Estimativas Consistentes.

6.3. O Método das Variáveis Instrumentais.

6.4. Modelos com Variáveis Defasadas.

7. Equações Simultâneas.

7.1. Sistema de Equações Simultâneas - Problemas de Identificação.

7.2. O Estimador de Variável Instrumental.

7.3. Métodos de Mínimos Quadrados Indiretos.

7.4. Métodos de Mínimos Quadrados em Dois Estágios.

7.5. Aplicações.

8. Introdução à Análise de Séries Temporais.

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

GRIFFITHS, W. E. , HILL, R. C. & JUDGE, G. G. - Econometria. Editora Saraiva, 1998.

HOFFMAN, R. & VIEIRA, S. - Análise de regressão. 2ª ed., São Paulo, Ed. Hucitec, 1987.

KMENTA, J. - Elementos de econometria. Atlas, 1978.

MATOS, O. C. - Econometria básica. 2ª ed., Atlas, 1997.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

BARBOSA, F. H. - Microeconomia: teoria, modelos econométricos e aplicações à economia brasileira. Editora IPEA/INPES. 1985.

BERNDT, E. - The practice of econometrics: classic and contemporary. Addison Wesley, 1990.

GREENE, W. H. - Econometric analysis. 3ª edition, Prentice-Hall. 1997.

GRIFFITHS, W. E. , HILL, R. C. & JUDGE, G. G. - Learning and practicing econometrics. New York, John Wiley & Sons, Inc. 1993. 866 p.

HENDRY, D. & MORGAN, M. - The foundation of econometric analysis. Cambridge. 1995.

HOFFMAN, R. - Estatística para economistas. 2ª ed., Editora Pioneira, São Paulo. 1991.

INTRILIGATOR, M. D. - Econometric models. techniques and applications. Ed. Prentice-Hall. 1978.

JOHNSTON, J. - Métodos econométricos. Atlas, 1974.

JUDGE, G. , GRIFFITHS, W. , HILL, R. , LUTKEPOHL, R. & LEE, H. - The theory and practice of econometrics. John Wiley & Sons, 1988.

MADDALA, G. - Introduction to econometrics. Ed. Prentice-Hall, 1992.

MATOS, O. C. - Econometria básica. 2ª ed., Atlas, 1997.

MORETTIN, P. & TOLLOI, C. - Previsão de séries temporais. Atual Editora Ltda, 1985.

PINDICK, R. & RUBINFELD, D. - Econometric models & economic forecasts. 4ª Edition, McGraw-Hill, 1997.

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

Curitiba, 06 de abril de 2022.



Documento assinado eletronicamente por **JOSE GUILHERME SILVA VIEIRA, CHEFE DO DEPARTAMENTO DE ECONOMIA - SA**, em 08/04/2022, às 16:44, conforme art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006.



A autenticidade do documento pode ser conferida [aqui](#) informando o código verificador **4403236** e o código CRC **ED1AB821**.