



## UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARANÁ

INFORMAÇÃO Nº 267/2022/UFPR/R/SA/DEPECON

### **PROGRAMA DA DISCIPLINA DE ESTATÍSTICA ECONÔMICA E INTRODUÇÃO À ECONOMETRIA I - CÓDIGO SE054\***

Pré-requisito: CE003 - Estatística II + SE460 - Introdução à Economia B

Carga horária: 60 (sessenta) horas

Créditos: 04 (quatro)

Natureza: semestral

#### **EMENTA**

- Notação Matricial.
- Problemas de análise de regressão.
- Noções de simulação pelo método Monte-Carlo.
- Análise de séries temporais.
- Construção e uso de número-índices.

#### **PROGRAMA**

1. Metodologia Quantitativa da Pesquisa Econômica
  
2. Análise da Regressão

### 3. Regressão Simples

#### 3.1. Propriedades e cálculo dos parâmetros

#### 3.2. Inferência sobre os parâmetros

### 4. Análise da variância

### 5. Análise da correlação

### 6. Regressão por anamorfose.

### 7. Regressão Linear Múltipla.

#### 7.1. Cálculo dos parâmetros.

#### 7.2. Matriz de variância e covariância.

#### 7.3. Inferência sobre os parâmetros.

#### 7.4. Teste de significância global.

#### 7.5. Ajuste polinomial.

### 8. Problemas de Análise de regressão.

#### 8.1. Uso de variáveis binárias.

#### 8.2. Autocorrelação

#### 8.3. Heterocedasticidade.

#### 8.4. Multicolinearidade.

### 9. Análise das séries temporais.

#### 9.1. Tendência.

#### 9.2. Sazonalidade.

#### 9.3. Elementos aleatórios.

### 10. Números-Índices.

#### 10.1. Conceito e características.

#### 10.2. Cálculo dos principais índices de preços e de quantidade

## 11. Simulação.

### 11.1. Conceito.

### 11.2. Método Monte-Carlo.

## 12. Métodos computacionais aplicados.

### 12.1. Introdução à informática.

### 12.2. Uso de planilhas eletrônicas.

### 12.3. Uso de pacotes estatísticos.

## **BIBLIOGRAFIA**

HOFFMANN, R., VIEIRA, S. - Análise de Regressão - Uma Introdução à Econometria, HUCITEC, São Paulo, 1987.

JAMES, D.E.; THROSBY, C.D. - Métodos Quantitativos Aplicados à Economia, Atlas, São Paulo, 1977.

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

KASMIER, L.J.; Estatística Aplicada à Economia e Administração, McGraw-Hill do Brasil, São Paulo, 1982.

KMENTA, J. - Elementos de Econometria, Atlas, São Paulo, 1978.

KOUTSOYANNIS, A. - Theory of Econometrics - an introductory exposition of econometric methods, Macmillan, 1972.

MAILLET, P. - A Econometria, Mira-Sintra: Europa-América, 1976.

MUNHOZ, D.G. - Economia Aplicada - técnicas de pesquisa e análise econômica, Editôra da UnB, Brasília, 1989.

POIRIER, D.J. - Intermediate Statistics and Econometrics - a comparative approach, London: The MIT Press, 1995.

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 06/04/2022, às 13:14, conforme art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006.



A autenticidade do documento pode ser conferida [aqui](#) informando o código verificador **4399631** e o código CRC **CA30FA2B**.

Referência: Processo nº 23075.021176/2022-41

SEI nº 4399631