



## UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARANÁ

INFORMAÇÃO Nº 136/2022/UFPR/R/SA/DEPECON

### **PROGRAMA DA DISCIPLINA DE ESTATÍSTICA ECONÔMICA E INTRODUÇÃO À ECONOMETRIA - CÓDIGO SE305**

Pré-requisito: Estatística II - CE003

Carga horária: 75 (setenta e cinco) horas

Créditos: 05 (cinco)

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 números-índices.

#### **CONTEÚDO PROGRAMÁTICO**

##### **1 – Introdução.**

##### **2 – Conceitos Básicos de Estatística.**

2.1 – Medidas de Tendência Central;

2.1.1 – Médias aritmética, geométrica, ponderada, harmônica;

2.1.2 – Mediana;

2.1.3 – Moda;

2.1.4 – Posição relativa da média, mediana e da moda e a assimetria da distribuição;

2.2 – Medidas de Dispersão;

2.2.1 – Amplitude, variância e desvio-padrão;

2.2.2 – Desvio-médio e diferença média;

2.3 – Variáveis aleatórias, função densidade de probabilidade, e principais distribuições estatísticas;

2.4 – Esperança Matemática, Variância, Covariância, Correlação;

2.4.1 – Esperança matemática: definição e propriedades;

2.4.2 – Variância: propriedades;

2.4.3 – Covariância: definição e propriedades;

2.5.4 – Análise de correlação.

### **3 – Números-Índices.**

3.1 - Preços Relativos;

3.2 - Índice Simples de Preços Agregados e a Média Aritmética dos Preços Relativos

3.3 - Índice de Preços de Laspeyres e o Índice de Preços de Paasche;

3.4 - Índice de Fischer e o Índice de Marshall-Edgeworth;

3.5 – Deflacionamento.

### **4 - Medidas de Desigualdade.**

4.1 - O Princípio de Pigou-Dalton e as Transferências Regressivas;

4.2 - A Curva de Lorenz e o Índice de Gini;

4.2.1 - O Índice de Gini para uma Distribuição Discreta;

4.3 – Redundância;

4.4 – Índice de Theil;

4.5 – Variância dos Logaritmos.

### **5 - Inferência Estatística: Estimação.**

5.1 - Parâmetro e Estimador;

5.2 - A Média e a Variância da Média;

5.3 - Estimador Não-Tendencioso;

5.4 - Estimador de Variância Mínima;

5.5 - Estimador de Mínimos Quadrados;

5.6 - Estimador Consistente.

### **7 - Introdução à Econometria.**

7.1 - Conceitos e Objetivos;

7.2 – Modelos;

7.3 - Especificação de Modelos Econométricos.

### **8 - Análise de Regressão.**

8.1 – Análise de Regressão Linear Simples;

8.1.1 - O Modelo Estatístico de uma Regressão Linear Simples

8.1.2 - Pressuposições Básicas;

8.1.3 - Estimativas dos Parâmetros;

8.1.4 - O Modelo Simplificado;

8.1.5 - Variâncias e Covariâncias das Estimativas dos Parâmetros;

8.1.6 - Decomposição da Soma de Quadrados Total;

8.1.7 - Análise de Variância da Regressão;

8.1.8 - Teste de Hipóteses sobre os Parâmetros;

8.1.9 – Intervalos de Previsão e de Confiança;

## 8.2 – Análise de Regressão Múltipla.

### BIBLIOGRAFIA

- GRIFFITHS, W. E.; HILL, R. C. & JUDGE, G. G. Econometria. Editora Saraiva. 1998.
- GUJARATI, D. Econometria Basica. Makron Books. 2006.
- HOFFMANN, R. & VIEIRA, S. Análise de Regressão – Uma Introdução à Econometria. Hucitec, São Paulo, 1987.
- HOFFMANN, R. Estatística Para Economistas. 2ª Ed. Livraria Pioneira, São Paulo, 1991.
- KMENTA, J. Elementos de Econometria. Atlas, São Paulo, 1978.
- MADDALA, G.S. Introdução à Econometria. Prentice-Hall, 1995.
- MATOS, O.C. Econometria Básica: Teoria e Aplicações. Atlas, São Paulo, 1997.
- MILONI, G. e ANGELINI, F. Estatística Aplicada. Atlas, 1995.
- MIRER, T.W. Economic Statistics and Econometrics . 3ª. Ed. Prentice-Hall, 1995.
- PINDYCK, R.S. & RUBINFELD, D.L. Econometria. Editora Campus,2004.
- SARTORIS, A. Estatística e Introdução à Econometria. Saraiva, 2004.
- WOOLDRIDGE, J. Introductory Econometrics. 2ª Edition. South-Western. 2003.

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 **4393867** e o código CRC **E5D6C360**.