



## UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARANÁ

INFORMAÇÃO Nº 225/2022/UFPR/R/SA/DEPECON

### **PROGRAMA DA DISCIPLINA DE ECONOMETRIA - CÓDIGO SE444\***

Pré-requisito: CE420 - Estatística Econômica e Introdução a Econometria.

Carga horária: 120 (cento e vinte) horas.

Créditos: 08 (oito).

Natureza: Anual.

### **EMENTA**

- Modelos Econométricos.
- Métodos Econométricos.
- Modelos e Métodos de Programação.
- Econometria Aplicada.

### **PROGRAMA**

#### 1. Introdução.

1.1.O Método Econométrico: Tipos de Modelos; Modelos Econométricos.

#### 2. Métodos Econométricos.

2.1.Estimação de uma equação única (revisão) ; Método de mínimos quadrados; testes.

2.2. Problemas no modelo de regressão linear - Multicolinearidade, Heterocedasticidade; Autocorrelação, Variáveis defasadas; testes e solução do problema.

2.3. Métodos de estimação com informação limitada - Mínimos quadrados ordinários; mínimos quadrados indiretos; mínimos quadrados de dois estágios; variáveis instrumentais.

3. Modelos Econométricos.

3.1. Aplicações econômicas, forma estrutural, forma reduzida e forma final, estabilidade.

3.2. Identificação do modelo econométrico geral.

4. Modelos e Métodos de Programação: Introdução.

4.1. Programação com modelos econométricos.

4.2. Programação com modelos de relações intersetoriais; análise de atividades.

5. Econometria Aplicada.

5.1. Apresentação introdutória - análise estrutural, previsão e programação, análise dos multiplicadores, métodos de previsão.

5.2. Análise de algumas aplicações selecionadas.

## **BIBLIOGRAFIA**

INTRILIGATOR, M. D. - Econometric Models. Techniques and Applications. Editora Prentice-Hall, Inc.- texto. 1978.

ASSIS, N. P.- Um Modelo Macroeconômico de Política a Curto Prazo para o Brasil. Editora IPEA/INPES, Monografia, Referência em Português, 1985.

BARBOSA, F. H. - Microeconomia: Teoria, Modelos Econométricos e Aplicações a Economia Brasileira. Editora IPEA/INPES, PNPE, 10, Referência em Português, 1985.

SALVATORE, D. - Estatística e Econometria. McGraw-Will do Brasil Ltda. Referência em Português. 1983.

WONNACOTT, R. J. - Econometria. 2. Ed., Editora LTC S/A, Referência em Português, 1978.

KMENTA, J. - Elementos de Econometria. Atlas, Referência em Português, 1978.

KELEJIAN, H. H. & OATES, W. E. - Introdução a Econometria. Campus, 1978.

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 **4399099** e o código CRC **23D5C34F**.

Referência: Processo nº 23075.021176/2022-41

SEI nº 4399099