

CURSO: CIÊNCIAS ECONÔMICAS	PLANO DE ENSINO
-----------------------------------	------------------------

DISCIPLINA: ECONOMETRIA II	CÓDIGO: ECO31081	CARGA HORÁRIA: 80 HORAS	CRÉDITOS: 04
--------------------------------------	----------------------------	-----------------------------------	------------------------

ANO LETIVO: 2024	SEMESTRE: 1	PERÍODO: 5°	TURMA: 5° PERÍODO
-------------------------	--------------------	--------------------	--------------------------

PROFESSOR (A): Walberti Saith

OBJETIVO DO CURSO:

Oferecer formação de nível superior em Ciências Econômicas a egressos do ensino médio, pautada, sobretudo, na ampliação dos horizontes intelectuais (constituindo uma base cultural ampla, que possibilite o entendimento de questões econômicas no seu contexto histórico-cultural) de modo a propiciar as competências e habilidades da profissão, respeitado o perfil profissional que preside o projeto pedagógico do curso. Além disso, o curso busca promover o ensino, a pesquisa e a extensão.

OBJETIVO DO DISCIPLINA:

Iniciar o estudante no estudo da Econometria, capacitando-o a entender e a utilizar ferramentas metodológicas associadas a essa área do conhecimento para estudar fenômenos econômicos. Dessa forma, a disciplina permite que o estudante seja apto a compreender quais são os métodos econométricos mais usuais na literatura para a formulação, estimação e testes de modelos econômicos, possibilitando que o aluno analise as relações econômicas e as implicações dela decorrentes sobre a sociedade como um todo.

AULAS POR UNIDADE:

Unidade I – 40 aulas
Unidade II – 40 aulas

EMENTA:

Modelo de regressão linear: álgebra linear; relaxando as premissas do modelo. Clássico de regressão linear. Multicolineariedade. Heterocedasticidade. Autocorrelação. Modelos de série temporal. Modelo Autoregressivo Integrado de Média Móveis – ARIMA. Modelos Vetor Autoregressivo – VAR e Vetor de Correção de Erros – VEC.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO:

Unidade I – Relaxamento Das Hipóteses Do Modelo Clássico

1. Multicolinearidade: o que acontece se os regressores estiverem correlacionados?
2. Heterocedasticidade: o que acontece se a variância do erro não é constante?
3. Autocorrelação: o que acontece se os termos de erro são correlacionados?

Unidade II – Séries Temporais.

1. Econometria de séries temporais: alguns conceitos básicos
2. Econometria de séries temporais: previsão

METODOLOGIA

- ◆ Elaboração de material de trabalho aplicado em sala de aula;
- ◆ Execução de aulas práticas no laboratório de informática.

AVALIAÇÃO:

- ◆ Lista de exercício – 25%;
- ◆ Provas – 25%
- ◆ Artigo Final – 50%.

BIBLIOGRAFIA:

Básica:

GUJARATI, D. N. **Econometria básica**. 5. ed. - São Paulo: Pearson Makron Books, 2011.

BUENO, R. de Losso da S. **Econometria de séries temporais**. São Paulo: Cengage Learning, 2011.

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. **Introdução à econometria - uma abordagem moderna**. 4. ed. – São Paulo: Cengage Learning, 2010.

COMPLEMENTAR:

HOFFMANN, R. **Estatística para economistas**. São Paulo: Pioneira, 2002.

HOFFMANN, R.; VIEIRA, S. **Análise de regressão**. Uma introdução à econometria. 3 ed. – São Paulo: Hucitec, 1998.

MORETTIN, Pedro A. **Econometria financeira** – um curso em séries temporais financeiras. 2. ed. - São Paulo: Edgard Blucher, 2011.

NEVES, Cesar das; ROSSI, José W. **Econometria e Séries Temporais** - com aplicações e dados da economia brasileira. São Paulo: Editora LTC, 2014.

PINDYCK, R.; RUBINFELD, D. **Econometria** – modelos e previsões. Rio de Janeiro: Campus, 2004.