



**INSTITUTO DE ESTUDOS EM DESENVOLVIMENTO AGRÁRIO E REGIONAL
FACULDADE DE CIÊNCIAS ECONÔMICAS**

Disciplina: Tópicos Especiais em Econometria – Código: ECO01109

Professor: Jorge Eduardo Macedo Simões

E-mail: jorge.simoes@unifesspa.edu.br/jsimoesf@yahoo.com.br

Turma: 2016

Carga horária semanal: 04 horas/semana Carga horária total: 60 horas

Ano letivo: 2020 Semestre: 1º Período: 2º Início: 02/03/2020 Término: 04/07/2020

PLANO DE ENSINO

1. EMENTA

Aplicações avançadas de modelos econométricos.

2. OBJETIVO

Apresentar alguns instrumentos de “medição econômica” necessários para a elaboração de estudos empíricos na área de economia.

3. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

3.1 Introdução ao uso do eviews (capítulo 1 – Soares e Castelar, 2004)

- 3.1.1 Principais áreas do Eviews;
- 3.1.2 Criando um workfile no Eviews;
- 3.1.3 Importando dados do Excel;
- 3.1.4 Gerando séries no Eviews;
- 3.1.5 Gerando objetos no Eviews;
- 3.1.6 Gerando gráficos no Eviews;
- 3.1.7 Histograma e estatísticas descritivas.

3.2 Fundamentos estatísticos (capítulo 2 – Bueno, 2011)

- 3.2.1 Médias móveis;
- 3.2.2 Médias móveis de ordem 1 – MA(1);
- 3.2.3 Médias móveis de ordem q – MA(q);
- 3.2.4 Processos autorregressivos;
- 3.2.5 Processos autorregressivos de ordem 1 – AR(1);
- 3.2.6 Processos autorregressivos de ordem p – AR(p);
- 3.2.7 Processo autorregressivo de médias móveis – ARMA (p,q).

3.3 Processos estacionários (capítulo 3 – Bueno, 2011)

- 3.3.1 Função de autocorrelação (FAC);

- 3.3.2 Função de autocorrelação parcial (FACP);
- 3.3.3 Identificação;
- 3.3.4 FAC e FACP;
- 3.3.5 Critério de informação;
- 3.3.6 Identificação de modelos AR, MA e ARMA;
- 3.3.7 Diagnóstico de resíduos;
- 3.3.8 Testes de normalidade.
- 3.3.9 Teste Jarque-Bera;
- 3.3.10 Teste LM;
- 3.3.11 Teste ARCH-LM;
- 3.3.12 Teste RESET;
- 3.3.13 Previsão;
- 3.3.14 Sazonalidade.

3.4 Processos não estacionários (capítulo 4 – Bueno, 2011)

- 3.4.1 Tendência estacionária e estocástica;
- 3.4.2 Passeios aleatórios;
- 3.4.3 Removendo a tendência;
- 3.4.4 Regressão espúria;
- 3.4.5 Testes de raiz unitária;
- 3.4.6 Dickey-Fuller;
- 3.4.7 Dickey-Fuller Aumentado;
- 3.4.8 Phillips-Perron;
- 3.4.9 Decomposição de Beveridge-Nelson.

3.5 Volatilidade (capítulo 8 – Bueno, 2011)

- 3.5.1 ARCH;
- 3.5.2 Extensões.

3.6 Vetor autorregressivo (capítulo 6 – Bueno, 2011)

- 3.6.1 Especificação do modelo;
- 3.6.2 Testando hipóteses;
- 3.6.3 Inferência;
- 3.6.4 Verificação;
- 3.6.5 Previsão;
- 3.6.6 Função impulso resposta;
- 3.6.7 Decomposição da variância;
- 3.6.8 Teste de Granger – Causalidade.

3.7 Vetor de correção de erros (capítulo 7 – Bueno, 2011)

- 3.7.1 Teste de cointegração de Engle-Granger;
- 3.7.2 Modelo de correção de erros;
- 3.7.3 Teste de cointegração de Johansen.

3.8 Análise de regressão (capítulos 2 e 3 – Wooldridge, 2010)

- 3.8.1 Regressão simples;
- 3.8.2 Regressão múltipla;

3.9 Dados em painel (capítulos 13 e 14 – Wooldridge, 2010)

- 3.9.1 Efeitos fixos;
- 3.9.2 Efeitos aleatórios.

4. METODOLOGIA

O conteúdo programático será desenvolvido por meio de aulas expositivas-dialogadas, com uso de quadro, data-show e computador (para a realização das aplicações através de softwares econométricos). Serão aplicados exercícios a serem resolvidos em classe e extra classe, individual e em grupo, dos conteúdos lecionados.

5. FORMAS E MOMENTOS DE AVALIAÇÃO

5.1 Trabalhos empíricos

- 5.1.1 Trabalhos empíricos – 10,0 pontos

5.2 Exercícios

- 5.2.1 Resolução dos exercícios – 10,0 pontos

5.3 Seminários

- 5.3.1 Apresentação dos Seminários – 10,0 pontos

$$Nota Final = \frac{\sum_{i=1}^n \text{Trabalhos empíricos}}{n} \times 0,6 + \frac{\sum_{i=1}^n \text{Exercícios}}{n} \times 0,1 + \frac{\sum_{i=1}^n \text{Seminários}}{n} \times 0,3$$

6. CRONOGRAMA

Aula	Data	Conteúdo	Atividades propostas
01	10/03/2020	Apresentação do plano de ensino e Introdução ao uso do eviews	Teórica/Aplicada
02	17/03/2020	Introdução ao uso do eviews	Teórica/Aplicada
03	24/03/2020	Fundamentos estatísticos	Teórica/Aplicada
04	31/03/2020	Fundamentos estatísticos	Teórica/Aplicada
05	07/04/2020	Processos estacionários	Teórica/Aplicada
06	14/04/2020	Processos estacionários	Teórica/Aplicada
07	21/04/2020	Processos não estacionários	Teórica/Aplicada
08	28/04/2020	Processos não estacionários	Teórica/Aplicada
09	05/05/2020	Volatilidade	Teórica/Aplicada
10	12/05/2020	Volatilidade	Teórica/Aplicada
11	19/05/2020	Vetor autorregressivo	Teórica/Aplicada
12	26/05/2020	Vetor autorregressivo	Teórica/Aplicada
13	02/06/2020	Vetor de correção de erros	Teórica/Aplicada
14	09/06/2020	Vetor de correção de erros	Teórica/Aplicada
15	16/06/2020	Análise de regressão	Teórica/Aplicada

16	23/06/2020	Dados em painel	Teórica/Aplicada
17	30/06/2020	Entrega do resultado final	Teórica/Aplicada

7. REFERÊNCIAS BIBLIOGRÁFICAS

7.1 Básica

BUENO, R. DE L. DA S. **Econometria de séries temporais**. Cengage Learning, 2011.

GUJARATI, D. N. **Econometria Básica**. MAKRON Books do Brasil Ltda, 2006.

SANTANA, A. C. **Métodos Quantitativos em Economia: Elementos e Aplicações**. UFRA, 2003.

SOARES, I.; CASTELAR, I. **Econometria Aplicada com uso do EViews**. LTC Ed., 2004.

WOOLDRIDGE, J. M. **Introdução à Econometria: Uma Abordagem Moderna**. Ed Thomson, São Paulo, 2010.

REYNA, O. T. **Panel Data Analysis Fixed and Random Effects using Stata**. Princeton University, 2007.

7.2 Complementar

ENDERS, W. **Applied econometric time series**. John Wiley & Sons, 2008.

GREENE, W. H. **Econometric analysis**. Pearson Education India, 2003.

Marabá, 02/03/2020

Jorge Eduardo Macedo Simões

Dyeggo Rocha Guedes