



UNIVERSIDADE FEDERAL DE SANTA CATARINA
CENTRO SOCIOECONÔMICO
DEPARTAMENTO DE ECONOMIA E RELAÇÕES INTERNACIONAIS

PROGRAMA DE ENSINO

EMENTA:

Séries Temporais e conceito de estacionariedade; identificação de modelos, correlogramas, testes de raiz unitária e remoção de tendências; modelos autorregressivos e médias móveis: $AR(p)$, $MA(q)$, $ARMA(p, q)$ e $ARIMA(p, d, q)$; modelos generalizados autorregressivos com heteroscedasticidade condicional: $ARCH(p)$, $GARCH(p, q)$; vetor autorregressivo (VAR) e vetor de correção de erros (VEC).

1. IDENTIFICAÇÃO DA DISCIPLINA:

Código: CNM 6025

Nome: Análise de Séries Temporais

Créditos: 04

Carga Horária: 72h

2. PRÉ-REQUISITOS:

CNM6015 - Econometria

3. IDENTIFICAÇÃO DA OFERTA:

Curso de Graduação em Ciências Econômicas.

4. OBJETIVOS DA DISCIPLINA:

O objetivo deste curso é apresentar as ferramentas necessárias para desenvolver estudos aplicados na área de economia usando dados de séries temporais. Além disso, a teoria econométrica para análise de séries temporais econômicas será apresentada de forma a fundamentar o conhecimento das ferramentas.

5. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO:

1. Propriedades empíricas de séries temporais
2. Correlação serial, estacionariedade
3. Previsão

4. Causalidade de Granger
5. Tendências
6. Quebras estruturais
7. Exogeneidade
8. Cointegração
9. Heteroscedasticidade condicional

6. BIBLIOGRAFIA:

Bibliografia básica:

BUENO, R.L.S. Econometria de Séries Temporais. 2ª edição, São Paulo: Cengage Learning, 2011.

STOCK, J., WATSON, M. Econometria. São Paulo, Editora Pearson, 2004.

WOOLDRIDGE, J. Introdução à Econometria: Uma Abordagem Moderna. Thomson, 4ª edição, 2011.

Bibliografia complementar:

ENDERS, WALTER. Applied Econometric Time Series. Wiley, 2ª edição.

GUJARATI, Damodar N. Econometria Básica. Rio de Janeiro: Campus, 2006.

HAMILTON, James. Time Series Analysis, Princeton: Princeton University Press.

LUTKEPOHL, H. and KRATZIG, M. Applied Time Series Econometrics, Cambridge University Press, Cambridge, 2004.

MORETTIN, P.; TOLOI, C., Análise de Séries Temporais. Editora Blucher, 2004.