



**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, estacionaridade
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. 2<sup>a</sup> 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, 4<sup>a</sup> edição, 2011.

### **Bibliografia complementar:**

ENDERS, WALTER. Applied Econometric Time Series. Wiley, 2<sup>a</sup> 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.