



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

PROGRAMA DE ENSINO

EMENTA:

Modelos Autorregressivos com Defasagens Distribuídas e com Variáveis Dummy, Modelos de Suavização/Alisamento Exponencial, Modelos Box-Jenkins Mensuração de Medidas de Erro de Previsão, Técnicas de Monitoramento de Erros de Previsão, Métodos Ingênuos de Previsão, Modelos de Decomposição Clássica, Combinação e Integração de Previsões e Técnica Delphi.

1. IDENTIFICAÇÃO DA DISCIPLINA:

Código: CNM 6026

Nome: Métodos de Previsão de Séries Temporais

Créditos: 04

Carga Horária: 72h

2. PRÉ-REQUISITOS:

Sem pré-requisitos

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 usando previsões de séries temporais econômicas. 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. Modelos ARDD.
3. Suavização exponencial.

4. Modelos ARIMA.
5. Métricas de erro de previsão.
6. Técnicas de monitoramento de erros de previsão.
7. Decomposição clássica.
8. Combinação de previsões.
7. Técnica Delphi.

6. BIBLIOGRAFIA:

Bibliografia básica:

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

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

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

Bibliografia complementar:

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