



### 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 econometrística 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. 2<sup>a</sup> 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.