

Programa Analítico de Disciplina

ECO 455 - Econometria II

Departamento de Economia - Centro de Ciências Humanas, Letras e Artes

Catálogo: 2020

Número de créditos: 4

Carga horária semestral: 60h

Carga horária semanal teórica: 3h

Carga horária semanal prática: 1h

Semestres: I

Objetivos

A disciplina ECO 455 – Econometria II tem por objetivo apresentar os fundamentos da Econometria de Séries Temporais e empregá-los na análise de dados econômicos com o apoio de programas econométricos. Dessa forma, pretende-se capacitar o aluno no que concerne às técnicas utilizadas para modelamento e análise das séries temporais e à importância que essas desempenham na criação de estruturas matemáticas para representar o passado e prever o comportamento futuro.

Ementa

Econometria de Séries Temporais: abordagens clássica e moderna. Modelos de Heterocedasticidade Condicional. Modelos Multivariados de Séries de Tempo.

Pré e co-requisitos

ECO 450

Oferecimentos obrigatórios

Não definidos

Oferecimentos optativos

Curso

Grupo de optativas

Ciências Econômicas

Grupo 1

ECO 455 - Econometria II

Conteúdo					
Unidade	T	P	ED	Pj	To
1. Abordagem clássica da Econometria de Séries Temporais 1. Introdução a Análise de componentes de uma série temporal: Tendência; Sazonalidade; Ciclos; e Componentes Irregulares 2. A prática de dessazonalizar séries de preços e de vendas	8h	2h	0h	0h	10h
2. Abordagem moderna da Econometria de Séries Temporais 1. Modelos Univariados de Séries de Tempo 1.1 Análise de Estacionariedade 1.2 Modelos Univariados de Séries Temporais: AR; MA; ARMA; ARIMA; SARMA; SARIMA 1.3 Aplicação visando a previsão das estatísticas de ponto e de tendência em séries de tempo	15h	5h	0h	0h	20h
3. Modelos de Heterocedasticidade Condicional 1. ARCH 2. GARCH 3. TARCH 4. Aplicação visando a previsão de estatísticas de ponto e a estimação de séries de risco	8h	3h	0h	0h	11h
4. Modelos Multivariados de Série de Tempo 1. Modelos de Vetoriais Auto-regressivos (VAR) 1.1 Decomposição de variância 1.2 Impulso-Resposta 2. Co-integração 3. Modelos Vetoriais Auto-regressivos Co-integrados (VEC) 4. Testes de co-integração 5. Estimativas práticas de valores futuros e trajetórias de impulso-resposta	14h	5h	0h	0h	19h
Total	45h	15h	0h	0h	60h

(T)Teórica; (P)Prática; (ED)Estudo Dirigido; (Pj)Projeto; Total(To)

Planejamento pedagógico	
Carga horária	Itens
Teórica	Apresentação de conteúdo oral e escrito com o apoio de equipamento (projutor, quadro-digital, TV, outros); e Apresentação de conteúdo oral e escrito em quadro convencional
Prática	Prática demonstrativa realizada pelo professor ou monitor, Prática executada por todos os estudantes e Resolução de problemas
Estudo Dirigido	<i>Não definidos</i>
Projeto	<i>Não definidos</i>
Recursos auxiliares	<i>Não definidos</i>

ECO 455 - Econometria II

Bibliografias básicas

Descrição	Exemplares
GUJARATI, D.N. Econometria básica. São Paulo: Pearson Education, 2000.	11
PINDYCK, R. S.; RUBINFELD, D. L. Econometria: modelos e previsões. Tradução da quarta edição. Rio de Janeiro: Elsevier, 2004.	13
MORETIN, P. A; TOLOI, M. C. T. Análise de séries temporais. São Paulo: Edgard Blücher. 2004.	0

Bibliografias complementares

Descrição	Exemplares
SARTORIS, A. Estatística e introdução à econometria. São Paulo: Saraiva, 2003.	2
STOCK, J. H.; WATSON, M. W. Econometria. São Paulo: Pearson Education, 2004.	1
VASCONCELLOS, M. A. S.; ALVES, D. (Editores). Manual de econometria. São Paulo: Atlas, 2000.	0