

Programa Analítico de Disciplina

ERU 322 - Econometria de Séries Temporais

Departamento de Economia Rural - Centro de Ciências Agrárias

Catálogo: 2022

Número de créditos: 4
Carga horária semestral: 60h
Carga horária semanal teórica: 4h
Carga horária semanal prática: 0h
Semestres: I

Objetivos

Estudo das principais técnicas de análise de séries temporais
Estimação de modelos de séries temporais para preços agropecuários
Uso de técnicas de econometria de séries temporais para previsão de preços agropecuários

Ementa

Métodos de análises de séries temporais. Componentes de uma série temporal. Séries temporais estacionárias e não-estacionárias. Modelos univariados lineares de séries temporais. Modelagem de séries temporais univariadas estacionárias. Modelos multivariados.

Pré e correquisitos

ERU 321

Oferecimentos obrigatórios

Curso	Período
Agronegócio	7

Oferecimentos optativos

Não definidos

ERU 322 - Econometria de Séries Temporais

Conteúdo					
Unidade	T	P	ED	Pj	To
1. Métodos de análises de séries temporais 1. Análise no domínio de frequência 2. Análise no domínio de tempo	4h	0h	0h	0h	4h
2. Componentes de uma série temporal 1. Tendência 2. Ciclos 3. Sazonalidade	8h	0h	0h	0h	8h
3. Séries temporais estacionárias e não-estacionárias 1. Estacionaridade 2. Função de autocorrelação e de autocorrelação parcial 3. Testes de raiz unitária	8h	0h	0h	0h	8h
4. Modelos univariados lineares de séries temporais 1. Processo aleatório puro ou ruído branco (White Noise) 2. Passeio aleatório (Random Walk) 3. Modelos auto-regressivos (AR) 4. Modelos de médias móveis (MA) 5. Modelos mistos auto-regressivos e de médias móveis (ARMA) 6. Modelos ARIMA 7. Modelos SARIMA	12h	0h	0h	0h	12h
5. Modelagem de séries temporais univariadas estacionárias 1. Metodologia de Box	8h	0h	0h	0h	8h
6. Modelos multivariados 1. Co-integração 2. Modelos de correção de erro 3. Auto-regressões vetoriais 4. Aplicações ao agronegócio	20h	0h	0h	0h	20h
Total	60h	0h	0h	0h	60h

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

Planejamento pedagógico	
Carga horária	Itens
Teórica	Apresentação de conteúdo oral e escrito com o apoio de equipamento (projektor, quadro-digital, TV, outros); Apresentação de conteúdo oral e escrito em quadro convencional; e Seminários
Prática	Não definidos
Estudo Dirigido	Não definidos
Projeto	Não definidos
Recursos auxiliares	Não definidos

A autenticidade deste documento pode ser conferida no site <https://siadoc.ufv.br/validar-documento> com o código: 2GTT.48ND.CKWW

ERU 322 - Econometria de Séries Temporais

Bibliografias básicas

Descrição	Exemplares
MORETTIN, P. A. Econometria Financeira – Um curso em séries temporais financeiras. 2 ed. São Paulo: Edgard Blücher, 2011. 319p.	1
GUJARATI, Damodar N.; PORTER, Dawn C. Econometria básica. 5. ed. Rio de Janeiro: AMGH, 2011. xxiv, 924 p. ISBN 8535216642 (broch.)	8
PINDYCK, R. S.; RUBINEFELD, D. L. Econometria - modelos & previsões. 4. ed. Editora Campus, 2004. 726p.	1

Bibliografias complementares

Descrição	Exemplares
ENDERS, W. Applied econometric time series. New York: Jhon Wiley, 1995. 433p.	1
FAVERO, C. A. Applied macroeconometrics. New York: Oxford University Press, 2001. 282p.	1
FISCHER, S. Séries univariantes de tempo - metodologia de box & jenkins. Porto Alegre: Fundação de Economia e Estatística, 1992. 186p.	1
STATA. Manuais de referência. College Station: Stata Press, 2007.	1