

PLANO DE ENSINO

I. IDENTIFICAÇÃO

Curso: Ciências Econômicas

Departamento: Ciências Econômicas

Disciplina: Econometria II

Código: 53ECON2

Carga horária: 72 horas

Período letivo: 2025.2

Termo: 5º

Professor: Ana Paula Menezes Pereira

Contato: ana.menezes@udesc.br

II. EMENTA

Processos estocásticos. Testes de estacionariedade. Testes da raiz unitária. Processos estocásticos integrados. Cointegração e mecanismo de correção de erro. Modelos dinâmicos. Processos de média móvel. Processos auto-regressivos. Processos auto-regressivos com média móvel. Abordagem Box-Jenkins. Modelo auto-regressivo vetorial (VAR). Vetor de Mecanismo de Correção de Erro. Causalidade de Granger. Heterocedasticidade em séries temporais. Modelos Arch e Garch.

III. OBJETIVOS

Estimular nos alunos o desenvolvimento e a análise de estimativas melhor ajustadas, através de testes, diagnósticos e correções das violações dos pressupostos do modelo clássico de regressão linear, em especial aquelas associadas a séries temporais. Compreender a natureza e aplicações de modelos dinâmicos e de séries temporais. Conhecer e realizar aplicações utilizando técnicas econométricas.

IV. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

Parte I: Introdução às Séries temporais. Diagnóstico e correção de violações de pressupostos do modelo clássico em séries temporais. Processos estocásticos.

Parte II: Testes de estacionariedade. Testes de raiz unitária.

Parte III: Processos estocásticos integrados. Cointegração e mecanismo de correção de erro. Modelos dinâmicos. Causalidade de Granger.

Parte IV: Processos de média móvel. Processos auto-regressivos; Processos auto-regressivos com média móvel. Abordagem Box-jenkins; Modelo auto-regressivo vetorial (VAR).

Parte V: Heterocedasticidade em séries temporais. Modelos Arch e Garch.

V. METODOLOGIA DE ENSINO

Aula expositiva/dialogada com elaboração de exercícios de forma individual ou em grupo e utilização de outros instrumentos didático-pedagógicos que auxiliem na compreensão do conteúdo. Os exercícios práticos, quando indicado pela professora, poderão ser desenvolvidos com o auxílio de programas econométricos.

VI. SISTEMA DE AVALIAÇÃO

Os alunos serão avaliados por meio de:

- A) duas avaliações presenciais, individuais e sem consulta, com peso de 40% cada uma na Nota Final da disciplina;
- B) uma avaliação prático-teórica, individual e com consulta, realizada de forma presencial no Laboratório de Informática, valendo 20% da Nota Final.

Observações: Quando indicado pela professora, a resolução de exercícios, resolvidos de forma individual ou em grupo, poderá somar bônus extras nas notas das provas. Quando indicado pela professora, alguma pontuação das avaliações poderá ser realizada por meio de trabalhos aplicados.

As segundas chamadas serão realizadas de acordo com o normatizado na UDESC pela RESOLUÇÃO Nº 039/2015 – CONSEPE, em:

<https://secon.udesc.br/consepe/resol/2015/039-2015-cpe.pdf>

As normativas e resoluções que tratam das faltas, regime domiciliar e abono de faltas podem ser encontradas na página da Secretaria de Ensino de Graduação da ESAG, em: <https://www.udesc.br/esag/secretariadeeduacao/resolucoes/faltas>

Havendo alteração nas normativas da UDESC, diferentes formas de avaliações poderão ser feitas, sempre de acordo com os calendários e as normas vigentes, bem como as condições da Universidade.

VII. BIBLIOGRAFIA

Básica

GUJARATI, Damodar N. **Econometria Básica**. Rio de Janeiro: Campus, 2011.

HILL, R. Carter, GRIFFITHS, William E, JUDGE, George G. **Econometria**. São Paulo: Saraiva, 2003.

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. **Introdução à Econometria: Uma Abordagem Moderna**. São Paulo: Thomson, 2016.

Complementar

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

ENDERS, Walter. **Applied Econometric Time Series**. Second Edition. Wiley series in probability and statistics, 2010.

PEREDA, Paula Carvalho. **Econometria aplicada**. Rio de Janeiro GEN Atlas 2018.

PINDYCK, Robert S, RUBINFELD, Daniel L. **Econometria: modelos e previsões**. Rio de Janeiro: Campus, 2004.

STOCK, James H.; WATSON, Mark W. **Econometria**. São Paulo: Pearson/Addison Wesley, 2004

***Bibliografias auxiliares poderão ser indicadas durante o semestre.**