

PLANO DE ENSINO

I. IDENTIFICAÇÃO

Curso: Ciências Econômicas

Departamento: Ciências Econômicas

Disciplina: Econometria II

Código: 53ECON2

Carga horária: 72 horas **Período letivo:** 2023.2

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. Processos estocásticos.

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

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

Parte IV: 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.

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 três provas presenciais, individuais e sem consulta e por um trabalho de aplicação. Quando indicado pela professora, a resolução de exercícios, resolvidos de forma individual ou em grupo, poderá somar bônus extras nas notas das provas. O peso na média final de cada prova é de 30% e do trabalho final é de 10%.

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

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. 2.ed.

WOOLDRIDGE, Jeffrey M. **Introdução à Econometria: Uma Abordagem Moderna**. São Paulo: Thomson, 2006.

Complementar

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

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

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

*Bibliografias auxiliares poderão ser indicadas durante o semestre.