

## PLANO DE ENSINO

### I. IDENTIFICAÇÃO

**Curso:** Ciências Econômicas

**Departamento:** Ciências Econômicas

**Disciplina:** Econometria II

**Código:** 53ECON2

**Carga horária:** 72 horas    **Período letivo:** 2024.1

**Termo:** 5º

**Professor:** Ana Paula Menezes Pereira

**Contato:** [ana.menezes@udesc.br](mailto: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 de 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.

O peso na média final de cada prova é de 30% e do trabalho final é de 10%.

Quando indicado pela professora, a resolução de exercícios opcionais, resolvidos de forma individual ou em grupo, poderá somar bônus extras nas notas das provas.

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

O registro de frequência dos acadêmicos nos cursos de graduação da UDESC segue o disposto na Resolução Nº 045/2015 – 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, 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.