

PLANO DE ENSINO

I. IDENTIFICAÇÃO

Curso: Ciências Econômicas		
Departamento: Ciências Econômicas		
Disciplina: Econometria II		Código: 53ECON2
Carga horária: 72 horas	Período letivo: 2026.1	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

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

Testes de estacionariedade. Testes de raiz unitária.

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

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

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 10% da Nota Final;
- C)** ao longo do semestre, serão propostas atividades práticas e exercícios, cujos prazos de entrega e/ou apresentação serão definidos pela professora no momento da proposição da atividade, correspondendo, em conjunto, a 10% da média final.

As normas e resoluções que tratam da avaliação em **segunda chamada** podem ser encontradas na página da Secretaria de Ensino de Graduação da ESAG, em: <https://www.udesc.br/esag/secretariadegraduacao/resolucoes/avaliacoes>

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/secretariadegraduacao/resolucoes/faltas>

O uso de ferramentas de **Inteligência Artificial (IA)** será **permitido exclusivamente** para fins de revisão gramatical, formatação de textos e tradução inicial, desde que haja posterior revisão pelo(a) estudante.

É **proibida** a utilização de **Inteligência Artificial (IA)** como fonte primária para obtenção de conteúdo, para elaboração de respostas em provas ou para a redação de trabalhos acadêmicos, bem como a simples reprodução (copiar e colar) de conteúdo gerado por essas ferramentas.

DECLARAÇÃO OBRIGATÓRIA: Todo uso de IA deve ser explicitamente declarado, incluindo ferramenta, finalidade e processo de revisão aplicado.

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.