



UNIVERSIDADE ESTADUAL DE MARINGÁ
PRÓ-REITORIA DE ENSINO

PROGRAMA DE DISCIPLINA

Curso:	Ciências Econômicas	Campus:	Sede
Departamento:	Economia		
Centro:	Centro de Ciências Sociais Aplicadas		
COMPONENTE CURRICULAR			
Nome: Econometria III			Código: 11763
Carga Horária: 68	Periodicidade: Semestral	Ano de Implantação: 2022	
1. EMENTA			
Métodos de regressão para dados de séries temporais e seus problemas.			
2. OBJETIVOS			
Fornecer conteúdo empírico aos modelos econômicos e prover de estrutura e objetivos a análise econômica, proporcionar aos alunos aplicações com dados econômicos e utilização de <i>softwares</i> .			

3. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO
I. FUNDAMENTOS 1.1. Processos estocásticos 1.2 Autocovariância e autocorrelação 1.3. Médias móveis 1.4. Processos autorregressivos 1.5. Utilização de <i>software</i>
II. PROCESSOS ESTACIONÁRIOS 2.1. Função de autocorrelação e autocorrelação parcial -FAC e FACP 2.2. Identificação e estimação 2.3. Diagnóstico dos resíduos. 2.4. Utilização de <i>software</i>.
III. PROCESSOS NÃO ESTACIONÁRIOS 3.1. Tipos de tendências 3.2. Tratando tendências 3.3. Testes de raiz unitária 3.3.1 Dickey-Fuller aumentado 3.3.2. Philips-Perron 3.3.3. KPSS 3.3.4. NG e Perron
IV. VETOR AUTOREGRESSIVO - VAR 4.1. Especificação de modelo

- 4.2. Inferência e verificação
- 4.3. Teste de Granger-causalidade
- 4.4. VAR estrutural

V. VETOR DE CORREÇÃO DE ERROS – VEC

- 5.1. Teste de cointegração de Engle-Granger
- 5.2. Modelo de correção de erros
- 5.3. Teste de cointegração de Johansen

VI. MODELOS DA FAMÍLIA ARCH

- 6.1. Modelos arch(p)
- 6.2. Modelos garch(p,q)
- 6.3. Testes para detecção e identificação

4. REFERÊNCIAS

4.1- Básicas (Disponibilizadas na Biblioteca ou aquisições recomendadas)

BUENO, R. L. S. **Econometria de séries temporais**. 2ª ed. São Paulo: Cengage Learning, 2011.
 GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. **Econometria Básica**. Porto Alegre: McGrawHill Bookman, 5ª ed., 2011.
 WOOLDRIDGE, J. M. **Introdução à econometria: uma abordagem moderna**. São Paulo: Cengage Learning, 2011.

4.2- Complementares

HEISS, F. **Using R for introductory econometrics**. Dusseldorf: Createspace Independent Publishing Platform, 2016, 356p. (<http://www.urfie.net/read/index.html>)
 HEISS, F. BRUNNER, D. **Using python for introductory econometrics**. Createspace Independent Publishing Platform, 2020, 418p. (<http://www.upfie.net/read/index.html>)
 MORETTIN, P.A.; TOLOI, C.M.C. **Análise de series temporais: modelos lineares univariados**. São Paulo: Blucher. 3. Ed. 2018.
 MORETTIN, P.A.; TOLOI, C.M.C. **Análise de series temporais: modelos multivariados e não lineares**. São Paulo: Blucher. 2020.
 MORETTIN, P.A. **Econometria financeira: um curso em séries temporais financeiras**. São Paulo: Blucher. 2008.
 MORETTIN, P.A.; SINGER, J.M. **Estatística e ciência de dados**. São Paulo: LTC. 2022.
 BUSSAB, W.O.; MORETTIN, P.A. **Estatística básica**. São Paulo: Saraivauni 9. Ed. 2017.



UNIVERSIDADE ESTADUAL DE MARINGÁ
PRÓ-REITORIA DE ENSINO

CRITÉRIO DE AVALIAÇÃO DA APRENDIZAGEM

Curso:	Ciências Econômicas	Campus:	Sede
Departamento:	Economia		
Centro:	Centro de Ciências Sociais Aplicadas		
COMPONENTE CURRICULAR			
Nome: Econometria III		Código: 11763	
Turma(s): Todas vigentes	Ano de Implantação: 2023		Periodicidade: Semestral

Verificação da Aprendizagem www.pen.uem.br > Legislação > Normas da Graduação > Pesquisar por Assunto: Avaliação
Obs.: Apresentar abaixo quantas avaliações serão exigidas e detalhar o processo de verificação da aprendizagem (provas, avaliação contínua, seminários, trabalhos etc.), para obtenção das notas periódicas e Avaliação Final. Número mínimo de avaliações = 2 (duas)

Avaliação Periódica:	1ª	2ª	3ª	4ª
Peso:	1	1	--	--

1ª AVALIAÇÃO PERIÓDICA

1 (uma) prova escrita valendo 0 (zero) a 8 (oito) e trabalho valendo de 0 (zero) a 2 (dois)

2ª AVALIAÇÃO PERIÓDICA

1 (uma) prova escrita valendo 0 (zero) a 8 (oito) e trabalho valendo de 0 (zero) a 2 (dois)

AVALIAÇÃO FINAL:

1 (uma) prova escrita valendo 0 (zero) a 10 (dez) abrangendo o conteúdo ministrado

Aprovação do Departamento

Aprovação do Conselho Acadêmico