



UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA
PRÓ REITORIA DE ENSINO
DIRETORIA DE REGISTRO ESCOLAR

Programa Analítico de Disciplina

ERU322 Econometria de Séries Temporais

Departamento de Economia Rural - Centro de Ciências Agrárias

Número de créditos: 4		<u>Teóricas</u>	<u>Práticas</u>	<u>Total</u>
Duração em semanas: 15	Carga horária semanal	4	0	4
Períodos - oferecimento: I	Carga horária total	60	0	60

Pré-requisitos (Pré ou co-requisitos)*

ERU321

Ementa

Métodos de análises de séries temporais. Componentes de uma série temporal. Séries temporais estacionárias e não-estacionárias. Modelos univariados lineares de séries temporais. Modelagem de séries temporais univariadas estacionárias. Modelos multivariados.

Oferecimento aos Cursos

Curso	Modalidade	Período
Agronegócio	Obrigatória	7



UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA
PRÓ REITORIA DE ENSINO
DIRETORIA DE REGISTRO ESCOLAR

ERU322 Econometria de Séries Temporais

Seq	Aulas Teóricas	Horas/Aula
1	Métodos de análises de séries temporais 1.1. Análise no domínio de frequência 1.2. Análise no domínio de tempo	4
2	Componentes de uma série temporal 2.1. Tendência 2.2. Ciclos 2.3. Sazonalidade	8
3	Séries temporais estacionárias e não-estacionárias 3.1. Estacionaridade 3.2. Função de autocorrelação e de autocorrelação parcial 3.3. Testes de raiz unitária	8
4	Modelos univariados lineares de séries temporais 4.1. Processo aleatório puro ou ruído branco (White Noise) 4.2. Passeio aleatório (Random Walk) 4.3. Modelos auto-regressivos (AR) 4.4. Modelos de médias móveis (MA) 4.5. Modelos mistos auto-regressivos e de médias móveis (ARMA) 4.6. Modelos ARIMA 4.7. Modelos SARIMA	12
5	Modelagem de séries temporais univariadas estacionárias 5.1. Metodologia de Box & Jenkins para Modelos ARMA: Identificação 5.2. Estimção, Verificação, Previsão. Aplicações ao Agronegócio 5.3. Aplicações ao agronegócio	8
6	Modelos multivariados 6.1. Co-integração 6.2. Modelos de correção de erro 6.3. Auto-regressões vetoriais 6.4. Aplicações ao agronegócio	20



UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA
PRÓ REITORIA DE ENSINO
DIRETORIA DE REGISTRO ESCOLAR

ERU322 Econometria de Séries Temporais

Referências Bibliográficas

Bibliografia Básica:

- 1 - GUJARATI, D. N. Econometria básica. 4. ed. São Paulo: Editora Campus, 2006. 846p. [Exemplares disponíveis: 21]
- 2 - MORETTIN, P. A.; TOLOI, C. M. C. Modelos para previsão de séries temporais. Vol. I - 356p. e Vol. II - 623p. Rio de Janeiro, IMPA, 1981. [Exemplares disponíveis: 1]
- 3 - PINDYCK, R. S.; RUBINEFELD, D. L. Econometria - modelos & previsões. 4. ed. Editora Campus, 2004. 726p. [Exemplares disponíveis: 1]

Bibliografia Complementar:

- 4 - BRANDT, P. T.; WILLIAMS, J. T. Multiple time series models. London: Sage Publications, 2007. 98p. [Exemplares disponíveis: 1]
- 5 - ENDERS, W. Applied econometric time series. New York: Jhon Wiley, 1995. 433p. [Exemplares disponíveis: 1]
- 6 - FAVERO, C. A. Applied macroeconometrics. New York: Oxford University Press, 2001. 282p. [Exemplares disponíveis: 1]
- 7 - FISCHER, S. Séries univariantes de tempo - metodologia de box & jenkins. Porto Alegre: Fundação de Economia e Estatística, 1992. 186p. [Exemplares disponíveis: 1]
- 8 - GRIFFTHS, W. E.; HILL, R. C.; JUDGE, G. G. Learning and practicing econometrics. New York: John Wiley, 1993. 866p. [Exemplares disponíveis: Não informado.]
- 9 - QUANTITATIVE MICRO SOFTWARE. EViews 6.0 User's Guide. Irvine: QMS, 2007. [Exemplares disponíveis: Não informado.]
- 10 - STATA. Manuais de referência. College Station: Stata Press, 2007. [Exemplares disponíveis: 1]