



FICHA DE COMPONENTE CURRICULAR

CÓDIGO: GAM037	COMPONENTE CURRICULAR: Análise de Séries Temporais	
UNIDADE ACADÊMICA OFERTANTE: FACULDADE DE CIÊNCIAS INTEGRADAS DO PONTAL		SIGLA: FACIP
CH TOTAL TEÓRICA: 60	CH TOTAL PRÁTICA: -	CH TOTAL: 60

OBJETIVOS

Desenvolver modelos para dados indexados no tempo. Apresentar classes alternativas de modelos. Descrever probabilisticamente a função de previsão. Analisar dados usando *softwares* especializados.

EMENTA

Conceitos iniciais. Estacionariedade. Autocorrelação, modelos no domínio do tempo e da frequência. Métodos de decomposição e de amortecimento e de autorregressão. Modelagem Box-Jenkins: univariado, função de transferência e intervenção e multivariado. Análise espectral. Modelos estruturais: espaço de estado e previsão Bayesiana.



PROGRAMA

1. Introdução à análise de séries temporais
 - 1.1. Conceitos iniciais.

2. Econometria de séries temporais: testes
 - 2.1. Estacionariedade
 - 2.2. Raiz unitária
 - 2.3. Autocorrelação
 - 2.4. Causalidade
 - 2.5. Cointegração
 - 2.6. Heterocedasticidade

3. Econometria de séries temporais: modelagem
 - 3.1. Modelos de séries temporais
 - 3.2. Previsão com Modelos ARIMA e VAR
 - 3.3. Outros modelos

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

ALMEIDA, E. **Econometria espacial aplicada**. São Paulo: Alínea, 2012.

ANDERSON, D. R; SWEENEY, D. J.; WILLIAMS, T. A. **Estatística aplicada à administração e economia**. 2. ed. São Paulo: Thomson Learning, 2007.

GUJARATI, D. N. **Econometria básica**. 5. ed. São Paulo: McGraw-Hill, 2011.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

BUENO, R. L. S. **Econometria de séries temporais**. 2. ed. São Paulo: Cengage Learning, 2012.

HOFFMANN, R.; VIEIRA, S. **Análise de regressão: uma introdução à econometria**. 3. ed. São Paulo: Hucitec, 1998.

MORETTIN, P. A.; TOLOI, C. M. C. **Análise de séries temporais**. 2. ed. São Paulo: E. Blucher, 2006.

PINDYCK, R. S.; RUBINFELD, D. L. **Econometria: modelos & previsões**. Rio de Janeiro: Campus, 2004.

WOLDRIDGE, J. M. **Introdução à econometria: uma abordagem moderna**. 4. ed. São Paulo: Cengage Learning, 2011.



APROVAÇÃO

___ / ___ / _____

Carimbo e assinatura do Coordenador do Curso

___ / ___ / _____

Carimbo e assinatura do Diretor da
Unidade Acadêmica
(que oferece a disciplina)