



FICHA DE COMPONENTE CURRICULAR

CÓDIGO: PECC1049	COMPONENTE CURRICULAR: Econometria II	
UNIDADE ACADÊMICA OFERTANTE: Instituto de Economia e Relações Internacionais		SIGLA: IERI
CH TOTAL TEÓRICA: 60 horas	CH TOTAL PRÁTICA: 0 horas	CH TOTAL: 60 horas

1. OBJETIVOS

O objetivo geral da disciplina é desenvolver instrumentos econométricos no campo da econometria de séries temporais para discentes de pós-graduação em Economia interessados no aprofundamento de conhecimento técnico-quantitativo.

2. EMENTA

Conceitos básicos de séries temporais macroeconômicas e financeiras; Processos Estocásticos; Estacionariedade e Raiz Unitária; Ergodicidade; Ruído Branco; Tendência e Sazonalidade; Metodologia Box-Jenkins; Modelos Univariados (ARMA, ARIMA) ; Modelos Multivariados (VAR, VEC) ; Processos Cointegrados; Modelos Autorregressivos de Defasagens Distribuídas aplicados à Cointegração; Modelos para Volatilidade (ARCH, GARCH, EGARCH, TGARCH, etc) ; Modelos de Memória Longa (ARFIMA); Mudanças de Regime; Modelos de Espaço de Estados (Filtro de Kalman); Valor em Risco (VaR).

3. PROGRAMA

1. Conceitos básicos de séries temporais macroeconômicas e financeiras
2. Processos estocásticos; estacionariedade e raiz unitária
3. Ergodicidade; ruído branco; tendência e sazonalidade
4. Metodologia Box-Jenkins
5. Modelos univariados (ARMA, ARIMA)
6. Modelos multivariados (VAR, VEC)
7. Processos cointegrados; modelos autorregressivos de defasagens distribuídas aplicados à cointegração
8. Modelos para volatilidade (ARCH, GARCH, EGARCH, TGARCH etc.)
9. Modelos de memória longa (ARFIMA)
10. Mudanças de regime
11. Modelos de espaço de estados (filtro de Kalman)
12. Valor em risco (VaR)
13. Tópicos adicionais em econometria de séries temporais

4. BIBLIOGRAFIA BÁSICA

- ENDERS, W. **Applied Econometric Time Series**. Wiley, 3^a ed., 2009.
- BUENO, R. L. S. **Econometria de Séries Temporais**, Cengage Learning, 2^a ed., 2011.
- HAMILTON, J. D. **Time Series Analysis**. Princeton University Press, 1994.

5. BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

- MORETTIN, P. **Econometria Financeira**. Blucher, 2008.
- GREENE, W. H. **Econometric Analysis**. Prentice Hall, 7^a ed., 2011.
- WOOLDRIDGE, J. M. **Introdução à Econometria: Uma Abordagem Moderna**. Thomson Learning, 2017.

6. APROVAÇÃO

Carlos César Santejo Saiani
Coordenador(a) do PPGE

Haroldo Ramazini Junior
Diretor(a) do IERI



Documento assinado eletronicamente por **Carlos Cesar Santejo Saiani, Coordenador(a)**, em 14/03/2024, às 10:25, conforme horário oficial de Brasília, com fundamento no art. 6º, § 1º, do [Decreto nº 8.539, de 8 de outubro de 2015](#).



Documento assinado eletronicamente por **Haroldo Ramazini Junior, Diretor(a)**, em 14/03/2024, às 13:02, conforme horário oficial de Brasília, com fundamento no art. 6º, § 1º, do [Decreto nº 8.539, de 8 de outubro de 2015](#).



A autenticidade deste documento pode ser conferida no site https://www.sei.ufu.br/sei/controlador_externo.php?acao=documento_conferir&id_orgao_acesso_externo=0, informando o código verificador **5179484** e o código CRC **6225F157**.