



UNIVERSIDADE ESTADUAL DE MARINGÁ
PRÓ-REITORIA DE ENSINO

PROGRAMA DE DISCIPLINA

Curso:	Bacharelado em Estatística	Campus:	Sede
Departamento:	Estatística		
Centro:	Ciências Exatas		
COMPONENTE CURRICULAR			
Nome: Econometria e Análise de Intervenção (OPTATIVA)			Código: 11830
Carga Horária: 68 h/a	Periodicidade: Semestral	Ano de Implantação: 2022	
1. EMENTA			
Introdução aos principais conceitos na construção de modelos econométricos, modelos de regressão para séries temporais e modelos de volatilidade.			
2. OBJETIVOS			
Capacitar o aluno para realizar análises econométricas, além de reconhecer e solucionar os principais problemas inerentes a tais dados correlacionados no tempo.			

3. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO
<p>1) Modelos Econométricos Conceito Estrutura Classificação Qualidades de um modelo econométrico: Plausibilidade teórica, capacidade explanatória, qualidade das estimativas dos parâmetros, capacidade de previsão, simplicidade.</p> <p>2) Modelos de Regressão para séries temporais Efeito marginal Elasticidade</p> <p>3) Raiz Unitária Correlação serial na ausência e presença de variáveis dependentes defasadas Teste de Dickey-Fuller Teste de Breusch-Godfrey Modificação dos modelos para correção de erros: Correlação conhecida, correlação desconhecida, estimativa iterativa da autocorrelação - Procedimento de <i>Cochrane-Orcutt</i></p> <p>4) Análise de Intervenção Funções de transferência Intervenção temporária e permanente Efeitos da intervenção</p>

5) Processos Bivariados
Funções de covariância e correlação cruzada
Regressão espúria
Co-integração
Prewhitening
Causalidade de Granger
Teste de Eagle-Granger

6) Introdução aos Modelos para a Volatilidade
Retornos
Variância condicional
ARCH
GARCH

4. REFERÊNCIAS

4.1- Básicas (Disponibilizadas na Biblioteca ou aquisições recomendadas)

BOX, G. E. P, JENKINS, G. M., REINSEL, G. C. **Times series analysis: Forecasting and control**, Wiley, 4th Ed., 2015, 712p.

BUENO, R. L S. **Econometria de séries temporais**, 299 p., 2008.

CHATFIELD, C. **The Analysis of time series. An introduction**. 5th edition, 283 p. Chapman & Hall, 1996.

CRYER, J.; D.; CHAN, K.S. **Time series analysis**. With Applications in R. Series: Springer Texts in Statistics. 2nd ed. 2008.

ENDERS, W. **Applied econometrics time series**; Wiley, 4th Ed., 2014.

GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. **Basic Econometrics**. The McGraw-Hill Series, 5th Ed. 2008, 946p.

HILL, R.C.; GRIFFITHS, W.E.; JUDGE, G. G. **Econometria**. Saraiva. São Paulo, 1999.

MATOS, O. C. **Econometria básica: teoria e aplicações**. São Paulo, Atlas, 1995, 244p.

MORETTIN, P. A. **Econometria financeira: Um Curso em Séries Temporais Financeiras**, São Paulo, 2008.

PINDYCK, R.S.; RUBINFELD, D.L. **Econometria: Modelos e Previsão**. Campus, 2004, 726p.

WOOLDRIDGE, J. **Introductory econometrics: A modern approach**. Cengage Learning, 2013.

4.2- Complementares

Aprovado em reunião departamental do dia 27/09/2022, conforme ata n° 579 do DES.

Aprovado em reunião do Conselho acadêmico do Curso de Estatística do dia 28/09/2022, conforme ata n° 21.

APROVAÇÃO DO DEPARTAMENTO

APROVAÇÃO DO CONSELHO ACADÊMICO