



UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARANÁ

INFORMAÇÃO Nº 71/2022/UFPR/R/SA/DEPECON

PROGRAMA DA DISCIPLINA ECONOMETRIA DE SÉRIES TEMPORAIS

Ficha 1 (permanente)

Disciplina: Econometria de Séries Temporais						Código: SE646		
Natureza: ( ) Obrigatória Optativa		( x ) Semestral ( ) Anual ( ) Modular						
Pré-requisito: SE618		Co-requisito: -		Modalidade: ( x ) Presencial ( ) Totalmente EaD ( )..... % EaD*				
CH Total: 60	Padrão (PD): 30	Laboratório (LB): 30	Campo (CP): 0	Estágio (ES): 0	Orientada (OR): 0	Prática Específica (PE): 0	Estágio Formação Pedagógica (EFP): 0	de
<b>EMENTA (Unidade Didática)</b> Processos estacionários. Processos não-estacionários. Raiz unitária. Cointegração. Modelos Autoregressivos Vetoriais. Modelo de Correção de Erros. Modelos de Heterocedasticidade Condicionada Autoregressivo. Previsão. Filtros.								
<b>Chefe de Departamento ou Unidade equivalente:</b> José Guilherme Silva Vieira Assinatura: _____								

\*OBS (1): ao assinalar a opção % EAD, indicar a carga horária que será à distância.

Art. 9º da Resolução 30/90 – CEPE

**Padrão (PD):** conjunto de estudos e atividades desenvolvidos fundamentalmente nos espaços de aprendizagem considerados padrão para as modalidades de ensino presencial e de educação à distância (EAD).

**Laboratório (LB):** conjunto de estudos e atividades desenvolvidos fundamentalmente em espaços de aprendizagem estabelecidos com infraestrutura especializada, tais como laboratórios, oficinas e estúdios.

**Campo (CP):** conjunto de estudos e atividades desenvolvidos fundamentalmente mediante atividades de campo.

**Estágio (ES):** conjunto de estudos e atividades desenvolvidos fundamentalmente em ambientes de trabalho mediante estágios regulados pela Lei nº 11.778, de 25 de setembro de 2008.

**Orientada (OR):** conjunto de estudos e atividades direcionados à vivência na atuação acadêmica e/ou profissional, em seus mais amplos aspectos, desenvolvidos em espaços educacionais internos e/ou externos à UFPR, com a participação direta de docente responsável.

**Práticas Específicas (PE):** conjunto de atividades de natureza prática, desenvolvidas em ambientes que apresentem restrições ao quantitativo de alunos por docente e que exijam controle rigoroso envolvendo questões de segurança, dignidade, privacidade e sigilo e/ou atenção do docente individualizada ou a pequenos grupos para desenvolvimento do processo de ensino-aprendizagem, com a participação direta do docente responsável.

**Estágio de Formação Pedagógica (EFP):** conjunto de estudos e atividades desenvolvidas fundamentalmente no âmbito da educação básica, sob a forma de “práticas de docência” e “práticas pedagógicas de organização do trabalho escolar”, envolvendo a orientação direta docente em ações que vão desde a intermediação no acordo de colaboração entre a UFPR e os estabelecimentos de ensino, até o acompanhamento sistemático e processual do planejamento, da execução e da avaliação das atividades desenvolvidas pelos licenciandos, o que requer o contato contínuo e presencial do professor nos diferentes campos de estágio e conseqüentemente a limitação de alunos por turma.

#### **BIBLIOGRAFIA BÁSICA**

GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. *Econometria Básica*. 5. ed. Porto Alegre: AMGH Editora, 2011.

MORETTIN, P.; TOLLOI, C. *Análise de Séries Temporais*. 2. ed. São Paulo: Editora Blucher, 2006.

WOOLDRIDGE, J. *Introdução à Econometria: uma abordagem moderna*. São Paulo: Cengage, 2018.

#### **BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR**

BUENO, R. L.S. *Econometria de séries temporais*. 2. ed. São Paulo: Cengage, 2011.

ENDERS, W. *Applied Econometric Time Series*. 2nd ed. Hoboken: Wiley, 2004.

GRIFFITHS, W. E.; HILL, R. C. & JUDGE, G. G. *Econometria*. São Paulo: Editora Saraiva, 2003.

HAMILTON, J. D. *Time Series Analysis*. Princeton University Press, 1994.

MORETTIN, P. A. *Econometria Financeira: um curso em séries temporais financeiras*. 2. ed. Editora Blucher, 2011.

Confere com o original.

Departamento de Economia do Setor de Ciências Sociais Aplicadas da Universidade Federal do Paraná.

Curitiba, 01 de abril de 2022.



DEPARTAMENTO DE ECONOMIA - SA, em 01/04/2022, às 21:29, conforme art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006.

---



A autenticidade do documento pode ser conferida [aqui](#) informando o código verificador **4387337** e o código CRC **E76C05FB**.

---