



UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARANÁ

INFORMAÇÃO Nº 73/2022/UFPR/R/SA/DEPECON

PROGRAMA DA DISCIPLINA ECONOMETRIA FINANCEIRA

Ficha 1 (permanente)

Disciplina: Econometria Financeira				Código: SE648				
Natureza: () Obrigatória Optativa		(x)		(x) Semestral		() Anual () Modular		
Pré-requisito: SE614		Co-requisito: -		Modalidade: (x) Presencial () Totalmente EaD ()..... % EaD*				
CH Total: 60	Padrão (PD): 40	Laboratório (LB): 20	Campo (CP): 0	Estágio (ES): 0	Orientada (OR): 0	Prática Específica (PE): 0	Estágio Formação Pedagógica (EFP): 0	de
EMENTA (Unidade Didática) Modelo de Regressão Linear Clássico. Séries Temporais Univariados e Previsão. Modelos Multivariados. Modelando relações de longo prazo em Finanças. Modelando Volatilidade e Correlação. Modelos Espaço Estado. Dados em Painel. Modelos de Variáveis Dependente Limitadas. Utilização do R e Phyton.								
Chefe de Departamento ou Unidade equivalente: 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

GREENE, W. H. *Econometric Analysis*. 6.Ed. Prentice Hall, 2008.

GOURIWOUX, C. E JASIAK, J. *Financial Econometrics – Problems, Models, and Methods*. Princeton University Press, 2002.

MORETTIN, P. A. *Econometria Financeira: um curso em séries temporais financeiras*. Blucher, 2008.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

AIT-SAHALIEA, Y; PETER HANSEN, L. P. (editor) *Handbook of Financial Econometrics, Volume 1: Tools and Techniques*, North-Holland – Elsevier, 2010.

DAVIDSON, R. E MACKINNON, J. G. *Econometric Theory and methods*. Oxford University Press, 2003.

HEIJ, C., BOER, P. E FRANCES, P. H. *Econometric Methods with Applications in Business and Economics*. Oxford University Press, 2004.

PINDYCK, R. S. E RUBINFELD, D. L. *Econometria: Modelos & Previsões*. Elsevier, 2004.

STOCK, J. H. E WATSON, M. W. *Econometria*. Pearson Addison Wesley, 2004.

Confere com o original.

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



Documento assinado eletronicamente por **JOSE GUILHERME SILVA VIEIRA, CHEFE DO 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 **4387370** e o código CRC **E60DC764**.