

Universidade Federal do Ceará - UFC
Departamento de Economia Aplicada - DEA



Disciplina: EF0005 - ECONOMETRIA DAS SERIES TEMPORAIS

Professor: Roberto Tatiwa Ferreira

Ementa: Modelos univariados de séries temporais: ARMA, SARMA, abordagem de Box-Jenkins, previsão. Testes para raiz unitária, modelo ARIMA. Modelos para heterocedasticidade condicional: ARCH, GARCH e EGARCH. Modelos multivariados de séries temporais: vetores autorregressivos (VAR), cointegração e modelos com correção de erro: ECM e VECM.

Programa do Curso

1. Conteúdo Programático

1. Fundamentos

- Processos Estocásticos ; Autocovariância e Autocorrelação; Função de Autocorrelação; Estacionaridade e Ergodicidade

2. Processos Estacionários

- Processo Auto-Regressivo de Médias Móveis – ARMA
- Estacionaridade, Invertibilidade e Identificação; Estimação; Diagnóstico de Resíduos; Previsão; Sazonalidade. Modelos da Família ARCH.

3. Processos Não Estacionários

- Tendência Estacionária e Estocástica;
- Testes de Raiz Unitária.

4. Vetor Auto-Regressivo – VAR

- Estacionaridade, Invertibilidade e Identificação; Estimação; Especificação de Modelo; Teste de Hipóteses; Diagnóstico; Previsão
- Função Resposta ao Impulso e Decomposição da Variância; Teste de Granger – Causalidade; VAR Estrutural

5. Cointegração e Vetor de Correção de Erros – VECM

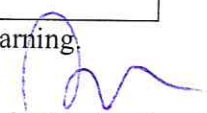
- Regressão Espúria
- Teste de Cointegração de Engle-Granger
- Modelo de Correção de Erros
- Teste de Cointegração de Johansen

2. Avaliação

Duas AP. Média 7,0 ou superior é aprovado por média. Caso contrário AF.


3. Bibliografia

Bueno , R. L. S. (2008). **Econometria de Séries Temporais**. Ed. Cengage Learning.


José Jarbas Souza
Secretário do Departamento
de Economia Aplicada
DEA FEAAC-UFC



- Enders, W. (2003). **Applied Econometric Time Series**. Ed. John Wiley & Sons.
- Gujarati, D (2006). **Econometria Básica**. 4ª edição. Campus
- Morettin, P.A. (2011). **Econometria Financeira – um curso em séries temporais financeiras**. Blucher.
- Wooldridge, J.M. (2011). **Introdução a Econometria- uma abordagem moderna**. Cengage Learning


José Jarbas Souza
Secretário do Departamento
de Economia Aplicada
DEA-FFAAC-UEFC