



UNIVERSIDADE FEDERAL DE SÃO CARLOS

Campus Sorocaba

Centro de Ciências em Gestão e Tecnologia

Coordenação do Curso de Ciências Econômicas

Rodovia João Leme dos Santos (SP 264), Km 110

Bairro: Itinga - Sorocaba - São Paulo - Brasil - CEP: 18052-780

Fone: (15) 3229-5949

ECONOMETRIA 2 - 495212

I – DEPARTAMENTO DE OFERTA: Departamento de Economia – DEc-So

II – CARGA HORÁRIA: 60h / 4 créditos

III – PERFIL DE OFERTA / CARÁTER: 5º perfil / obrigatória

IV – REQUISITOS: “Econometria 1”.

V – OBJETIVOS: Os alunos deverão compreender os procedimentos necessários para a modelagem econométrica de séries temporais. Ademais, o estudante deverá desenvolver a capacidade de aplicar esses métodos com o intuito de solucionar problemas econômicos que envolvam séries temporais.

VI – EMENTA: Análise clássica de séries temporais. Análise moderna de séries temporais: processos estocásticos. Modelos univariados de séries temporais - enfoque de Box & Jenkins. Modelagem de séries não-estacionárias: modelos de correção de erro. Introdução aos modelos multivariados de séries temporais.

VII – BIBLIOGRAFIA BÁSICA

- GUJARATI, D. Econometria Básica. Rio de Janeiro: Campus-Elsevier, 2006.

- MORETTIN, P. A.; TOLOI, C. M. C. Análise de séries temporais. São Paulo: Edgard Blucher, 2006.

- BUENO, R. L. S. Econometria de séries temporais. São Paulo: Cengage Learning, 2008.