



DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA  
CENTRO DE CIÊNCIAS EXATAS E DA NATUREZA  
UNIVERSIDADE FEDERAL DA PARAÍBA



**PROGRAMA DE COMPONENTE CURRICULAR DO CURSO DE  
BACHARELADO EM ESTATÍSTICA DA UFPB**

NOME DO COMPONENTE CURRICULAR		CRÉDITOS	CH TOTAL (h)
Econometria II		4	60
TIPO DE COMPONENTE		NATUREZA	DEPARTAMENTO
Disciplina		Optativa	Estatística
CH TEÓRICA (h)	CH PRÁTICA (h)	CH EAD (h)	CH EXTENSÃO (h)
60	0	0	0
EMENTA			
Sistema de contas nacionais; Balanço de Pagamentos; Análise IS-LM-BP; Oferta agregada e curva de Phillips; Principais instrumentos de política monetária; Deficit público; Modelos de Regressão; Séries Temporais. Aplicações.			
CONTEÚDO PROGRAMÁTICO			
<p>1 Introdução</p> <p>1.1 Sistema de contas nacionais</p> <p>1.2 Balanço de Pagamentos</p> <p>1.3 Análise IS-LM-BP</p> <p>1.4 Oferta agregada e curva de Phillips</p> <p>1.5 Principais instrumentos de política monetária</p> <p>1.6 Deficit público</p> <p>2 Modelos de Regressão</p> <p>2.1 Introdução</p> <p>2.2 Modelos de regressão linear simples</p> <p>2.3 Modelos de regressão linear múltipla</p> <p>2.3.1 Identificação do modelo</p> <p>2.3.2 Estimação</p> <p>2.3.3 Análise de resíduos</p> <p>2.3.4 Análise de diagnóstico</p> <p>2.4 Modelos de regressão não-linear</p> <p>2.5 Introdução a modelos lineares generalizados</p> <p>3 Séries Temporais</p> <p>3.1 Introdução</p> <p>3.2 Identificação do modelo ARIMA</p> <p>3.3 Estimação</p> <p>3.3.1 Modelos Autorregressivos</p> <p>3.3.2 Modelos de Médias Móveis</p> <p>3.3.3 Modelos Mistos</p> <p>3.4 Técnicas de Diagnósticos</p> <p>3.5 Previsão com modelos ARIMA</p> <p>3.6 Modelos Sazonais</p>			



DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA  
CENTRO DE CIÊNCIAS EXATAS E DA NATUREZA  
UNIVERSIDADE FEDERAL DA PARAÍBA



4 Aplicações

**BIBLIOGRAFIA BÁSICA**

1. GUJARATI, D. N. **Econometria**: princípios, teoria e aplicações práticas. São Paulo: Saraiva Educação, 2019. Disponível em: <<https://integrada.minhabiblioteca.com.br/reader/books/9788553131952>>. Minha Biblioteca.
2. MORETTIN, P. A. **Econometria financeira**: um curso em séries temporais financeiras. São Paulo: Blucher, 2016. Disponível em: <<https://integrada.minhabiblioteca.com.br/reader/books/9788521211310>>. Minha Biblioteca.
3. BUENO, R. L. S. **Econometria de séries temporais**. São Paulo: Cengage Learning, 2018. Disponível em: <<https://integrada.minhabiblioteca.com.br/reader/books/9788522128259>>. Minha Biblioteca.

**BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR**

1. CHAN, N. H. **Time Series**: Applications to Finance with R and S-Plus. New York: John Wiley & Sons, Incorporated, 2010. Disponível em: <<https://ebookcentral.proquest.com/lib/bcufpb-ebooks/detail.action?docID=699152>>. ProQuest Ebook Central.
2. LÜTKEPOHL, H.; KRÄTZIG, M. **Applied Time Series Econometrics**. Cambridge: Cambridge University Press, 2004. Disponível em: <<https://ebookcentral.proquest.com/lib/bcufpb-ebooks/detail.action?docID=266655>>. ProQuest Ebook Central.
3. TURNER, P. **Econometrics in Practice**. Bloomfield: Mercury Learning & Information, 2021. Disponível em: <<https://ebookcentral.proquest.com/lib/bcufpb-ebooks/detail.action?docID=6647709>>. ProQuest Ebook Central.
4. MILLS, T. C. **Time Series Econometrics**: A Concise Introduction. London: Palgrave Macmillan UK, 2015. Disponível em: <<https://ebookcentral.proquest.com/lib/bcufpb-ebooks/detail.action?docID=4001234>>. ProQuest Ebook Central.
5. AMISANO, G.; GIANNINI, C. **Topics in Structural VAR Econometrics**. Berlin: Springer Berlin / Heidelberg, 1997. Disponível em: <<https://ebookcentral.proquest.com/lib/bcufpb-ebooks/detail.action?docID=3093730>>. ProQuest Ebook Central.