



UNIVERSIDADE FEDERAL DE OURO PRETO
PRÓ-REITORIA DE GRADUAÇÃO
PROGRAMA DE DISCIPLINA



Disciplina ECONOMETRIA			Código: ENP537	
Disciplina equivalente (nome e código):				
Departamento de Engenharia de Produção			Unidade DEENP/ ICEA	
Carga Horária Semanal 04	Teórica 04	Prática 00	Duração/Semana 18	Carga Horária Semestral 60h ou 72 hora/aula
Ementa Modelos de regressão aplicados aos modelos econômicos: modelos univariados de séries de tempo, abordagem clássica e abordagem box-Jenkis (modelos arima). Teste de raiz unitária. Análise de cointegração.				
CONTEÚDO PROGRAMÁTICO				
1. INTRODUÇÃO À ECONOMIA <ul style="list-style-type: none">a. Economia: Conceito e definiçõesb. Sistema Econômico: Elementos Básicosc. Variáveis e indicadores econômicos				
2. MODELOS DE REGRESSÃO <ul style="list-style-type: none">a. Modelos aplicados à dados econômicosb. Modelos univariadosc. Modelos multivariadosd. Tratamento de autocorrelação entre predecessorase. Tratamento de séries heterocedásticas				
3. MODELO ARMA E ARIMA <ul style="list-style-type: none">a. Modelos autoregressivos (AR).b. Modelos de médias móveis (MA).c. Teste de raiz unitária.d. Análise de cointegração.e. Identificação de modelos.				



Bibliografia Básica

1. GUJARATI, D. N. **Econometria básica**. Rio de Janeiro : Elsevier, 4ª ed., 2006.
2. MORETTIN, P. A.; TOLOI, C. M. C. **Análise de series temporais**. Edgard Blucher, 2ª Ed., 2006.
3. BUENO, R. L. S. **Econometria de series temporais**. Cengage, 2ª Ed., 2011.

Bibliografia Complementar

1. TSAY, R. S. **Analysis of Financial Time Series**. Wiley, 3rd ed., 2010.
2. MANKIW, N. G. **Introdução à economia: Princípios de Micro e Macroeconomia**. Rio de Janeiro: Editora Campus, 1999.
3. MONTGOMERY, D. C.; RUNGER, G. C. **Estatística aplicada e probabilidade para engenheiros**. Rio de Janeiro : LTC, 2003.
4. LARSON, R.; FARBER, B. **Estatística Aplicada**. São Paulo: Pearson, 4 ed., 2009.
5. MAGALHÃES, M.N.; LIMA A.C.P. **Noções de Probabilidade e Estatística**. São Paulo: EDUSP, 7 ed., 2011.

h/a é igual a 50 minutos