



*Universidade Estadual de Maringá*  
*Centro de Ciências Exatas*

1

Resolução n°. 063/2022-CI/CCE

**RESOLUÇÃO Nº 063/2022-CI-CCE**

**CERTIDÃO**

Certifico que a presente resolução foi publicada no site <http://www.cce.uem.br/>, no dia 17/11/2022.

Aprova criação da disciplina optativa “Econometria e Análise de Intervenção” no Curso de Graduação em Estatística - Bacharelado.

Marta Satiko Kira Peron,  
Secretária do CCE.

Considerando o contido no e-Protocolo nº 19.564.613-9;  
considerando a aprovação do Conselho Acadêmico do curso de Estatística, em reunião realizada no dia 28/09/2022, conforme ATA no. 021 – DES;  
considerando o disposto no Inciso V do Art. 48 do Estatuto da Universidade Estadual de Maringá;

**O CONSELHO INTERDEPARTAMENTAL DO CENTRO DE CIÊNCIAS EXATAS APROVOU E EU, DIRETORA, SANCIONO A SEGUINTE RESOLUÇÃO:**

**Art. 1º** Aprovar a criação da disciplina optativa “*Econometria e Análise de Intervenção*” no Curso de Bacharelado em Estatística, com carga horária de 68 horas/aula, conforme os ANEXOS I e II, que passam a integrar a presente Resolução.

**Art. 2º** Esta resolução entra em vigor nesta data, revogadas as disposições em contrário.

Dê-se ciência.

Cumpra-se.

Maringá, 04 de novembro de 2022.

**ADVERTÊNCIA:**

O prazo recursal termina em 24/11/2022. (Art. 95 - § 1º do Regimento Geral da UEM)

Lilian Akemi Kato  
**DIRETORA**



**ANEXO I**

**RESOLUÇÃO Nº. 063/2022-CI/CCE**

**PROGRAMA DE DISCIPLINA**

Curso:	<b>Bacharelado em Estatística</b>	Campus:	<b>Sede</b>
Departamento:	<b>Estatística</b>		
Centro:	<b>Ciências Exatas</b>		
<b>COMPONENTE CURRICULAR</b>			
Nome:	<b>Econometria e Análise de Intervenção (OPTATIVA)</b>		Código:
Carga Horária: <b>68 h/a</b>	Periodicidade: <b>Semestral</b>	Ano de Implantação: <b>2022</b>	
<b>1. EMENTA</b>			
Introdução aos principais conceitos na construção de modelos econométricos, modelos de regressão para séries temporais e modelos de volatilidade.			
<b>2. OBJETIVOS</b>			
Capacitar o aluno para realizar análises econométricas, além de reconhecer e solucionar os principais problemas inerentes a tais dados correlacionados no tempo.			
<b>3. CONTEÚDO PROGRAMÁTICO</b>			
1) Modelos Econométricos Conceito Estrutura Classificação Qualidades de um modelo econométrico: Plausibilidade teórica, capacidade explanatória, qualidade das estimativas dos parâmetros, capacidade de previsão, simplicidade.			
2) Modelos de Regressão para séries temporais Efeito marginal Elasticidade			
3) Raiz Unitária Correlação serial na ausência e presença de variáveis dependentes defasadas Teste de Dickey-Fuller Teste de Breusch-Godfrey Modificação dos modelos para correção de erros: Correlação conhecida, correlação desconhecida, estimativa iterativa da autocorrelação - Procedimento de <i>Cochrane-Orcutt</i>			



- 4) Análise de Intervenção  
Funções de transferência  
Intervenção temporária e permanente  
Efeitos da intervenção
- 5) Processos Bivariados  
Funções de covariância e correlação cruzada  
Regressão espúria  
Co-integração  
Prewhitening  
Causalidade de Granger  
Teste de Eagle-Granger
- 6) Introdução aos Modelos para a Volatilidade  
Retornos  
Variância condicional  
ARCH  
GARCH

#### 4. REFERÊNCIAS

##### 4.1- Básicas (Disponibilizadas na Biblioteca ou aquisições recomendadas)

BOX, G. E. P, JENKINS, G. M., REINSEL, G. C. **Times series analysis: Forecasting and control**, Wiley, 4<sup>th</sup> Ed., 2015, 712p.

BUENO, R. L S. **Econometria de séries temporais**, 299 p., 2008.

CHATFIELD, C. **The Analysis of time series. An introduction**. 5th edition, 283 p. Chapman & Hall, 1996.

CRYER, J.; D.; CHAN, K.S. **Time series analysis**. With Applications in R. Series: Springer Texts in Statistics. 2nd ed. 2008.

ENDERS, W. **Applied econometrics time series**; Wiley, 4<sup>th</sup> Ed., 2014.

GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. **Basic Econometrics**. The McGraw-Hill Series, 5<sup>th</sup> Ed. 2008, 946p.

HILL, R.C.; GRIFFITHS, W.E.; JUDGE, G. G. **Econometria**. Saraiva. São Paulo, 1999.

MATOS, O. C. **Econometria básica: teoria e aplicações**. São Paulo, Atlas, 1995, 244p.

MORETTIN, P. A. **Econometria financeira: Um Curso em Séries Temporais Financeiras**, São Paulo, 2008.

PINDYCK, R.S.; RUBINFELD, D.L. **Econometria: Modelos e Previsão**. Campus, 2004, 726p.



WOOLDRIDGE, J. **Introductory econometrics: A modern approach.** Cengage Learning, 2013.

4.2- Complementares

Aprovado em reunião departamental do dia 27/09/2022, conforme ata n° 579 do DES.

Aprovado em reunião do Conselho acadêmico do Curso de Estatística do dia 28/09/2022, conforme ata n° 21.





ANEXO II

RESOLUÇÃO N°. 063/2022-CI/CCE

CRITÉRIO DE AVALIAÇÃO DA APRENDIZAGEM

Curso:	Bacharelado em Estatística	Campus:	Sede
Departamento:	Estatística		
Centro:	Ciências Exatas		
<b>COMPONENTE CURRICULAR</b>			
Nome: <b>Econometria e Análise de Intervenção (OPTATIVA)</b>		Código:	
Turma(s): <b>Todas</b>	Ano de Implantação: <b>2022</b>	Periodicidade: <b>Semestral</b>	

**Verificação da Aprendizagem**

[www.pen.uem.br](http://www.pen.uem.br) > Legislação > Normas da Graduação > Pesquisar por Assunto/Avaliação

Obs.: Apresentar abaixo quantas avaliações serão exigidas e detalhar o processo de verificação da aprendizagem (provas, avaliação contínua, seminários, trabalhos etc.), para obtenção das notas periódicas e Avaliação Final.

Número mínimo de avaliações = 2 (duas)

<b>Avaliação Periódica:</b>	<b>1ª</b>	<b>2ª</b>
<b>Peso:</b>	<b>1</b>	<b>2</b>

1ª AVALIAÇÃO PERIÓDICA:

01 (uma) prova escrita valendo de 0 (zero) a 10 (dez).

2ª AVALIAÇÃO PERIÓDICA:

01 (uma) prova escrita valendo de 0 (zero) a 10 (dez).

AVALIAÇÃO FINAL:

01 (uma) prova escrita valendo de 0 (zero) a 10 (dez).

A Nota Final (NF) será obtida pela média aritmética das notas periódicas. O aluno, com frequência igual ou superior a 75% que obter Nota Final inferior a 6,0 (seis) deverá ser submetido a Avaliação Final, sendo aprovado se obtiver Nota Média Final (NMF) igual ou superior a 5,0 (cinco), resultante da média aritmética simples entre a Nota Final (NF) e a Nota da Avaliação Final (NAF).



*Universidade Estadual de Maringá*  
*Centro de Ciências Exatas*

6

*Resolução n°. 063/2022-CI/CCE*

Aprovado em reunião departamental do dia 27/09/2022, conforme ata n° 579 do DES.  
Aprovado em reunião do Conselho acadêmico do Curso de Estatística do dia 28/09/2022,  
conforme ata n° 21.

