



Portal do Coordenador
Stricto

UNIVERSIDADE FEDERAL DO RIO GRANDE DO NORTE
SISTEMA INTEGRADO DE GESTÃO DE ATIVIDADES ACADÊMICAS

EMITIDO EM 04/05/2026 14:35



VISUALIZAR COMPROVANTE DE SOLICITAÇÃO DE CADASTRO DE COMPONENTE CURRICULAR

Tipo do Componente Curricular: DISCIPLINA

Unidade Responsável: PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ADMINISTRAÇÃO

Código: PPGA0155

Nome: SÉRIES TEMPORAIS

Ativo: Sim

Carga Horária Teórica: 60 hrs.

Carga Horária Prática: 0 hrs.

Carga Horária Ead: 0 hrs.

Carga Horária Total: 60 hrs.

Matriculável On-Line: Sim

Horário Flexível da Turma: Sim

Horário Flexível do Docente: Sim

Pode Criar Turma Sem Solicitação: Não

Exige Horário: Sim

Núm. Máximo de Docentes na Turma: 2

Modalidade de Educação: Presencial

Permite CH Compartilhada entre Docentes: Não

Permite Múltiplas Aprovações: Não

Quantidade de Avaliações: 1

Ementa/Descrição: Preliminares. Processos Estocásticos. Modelagem ARIMA. Estacionaridade e Raízes Unitárias. Modelos para Volatilidade (Família ARCH/GARCH). Modelos Lineares Multivariados (VAR e VEC). Processos Co-Integrados e Causalidade de Granger. Processos com Memória Longa para média e volatilidade (Modelos ARFIMA e FIGARCH).

Referências: BOX, G.E.P. & JENKINS, G.W. Time Series Analysis, Forecasting and Control. Holden-Day, 1976 BUENO, R. L. S. Econometria de Séries Temporais. 2 ed. São Paulo: Cengage Learning, 2011. ENDERS, Walter. Applied Econometric Time Series. New York: John Wiley & Sons – 2nd Ed. 2003 HAMILTON, J.D. Time Series Analysis. Editora Princeton 1998; MORETTIN, P.A. & TOLOI, C.M.C. Análise de Séries Temporais. São Paulo: Edgard Blucher, 1a ed, 2004. PEÑA, Daniel; TIAO, George C. & TSAY, Ruey S. A Course in Time Series Analysis. New York: John Wiley & Sons. 2001. TSAY, Ruey S. Analysis of Financial Time Series. New Jersey: John Wiley & Sons. 2010 WEI, William W.S. Time Series Analysis: Univariate and Multivariate Methods. New York: Pearson – 3rd ed. 2006.

Chefe de Departamento
PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ADMINISTRAÇÃO

SIGAA | Superintendência de Tecnologia da Informação - (84) 3342 2210 | Copyright © 2006-2026 - UFRN - sigaa09-
producao.info.ufrn.br.sigaa09-producao