



Ministério da Educação
Universidade Federal de Santa Maria
Centro de Ciências Sociais e Humanas
Programa de Pós-Graduação em Administração Pública



PPGAP | UFSM
Programa de Pós-Graduação
em Administração Pública

Nome do Projeto: Modelagem linear e não linear como ferramenta auxiliar para gestão de organizações públicas

Área de Concentração: GOVERNO, ORGANIZAÇÕES E SOCIEDADE

Linha de Pesquisa: ECONOMIA, POLÍTICAS E FINANÇAS PÚBLICAS

Natureza do Projeto: PESQUISA

Docente responsável: ADRIANO MENDONCA SOUZA

Descrição: A análise de séries temporais desempenha um papel importante dentre os métodos de previsão, pois, baseada na estrutura de autocorrelação das observações, ela é capaz de fornecer informações relacionadas ao comportamento da tendência, da sazonalidade entre outros fatores estilizados. Também é capaz de explicar como uma determinada variável se comportará quando outras variáveis sofrem alterações, sendo que a sua principal aplicação é a de se realizar previsões. A análise de séries temporais não tem só o interesse de estudar a média de um processo, mas também a sua volatilidade, fazendo com que a utilização conjunta destas duas abordagens traga uma maior assertividade e acurácia aos modelos encontrados e as previsões a serem realizadas. O objetivo de análise de séries temporais aplicada à administração é a de realizar por meio de modelos lineares (classe geral ARIMA) e não lineares (classe geral ARCH) a avaliação, a viabilidade e o monitoramento de variáveis econômicas ligadas ao setor privado e público. Não se busca a comparação entre os métodos e os modelos, mas sim aquele que seja capaz de refletir a realidade e prover valores futuros fidedignos para tomadas de decisões.