

ECONOMETRIA II

Pré-requisito:

C.H. Total: 80 h/a

4 créditos

Período: 4º

Código:

EMENTA:

Desenvolvimento de modelos para estimação e predição de variáveis e relações econômicas.

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

1. Apostila do professor
2. ENDERS, W. *Applied Econometric Time Series*, 2nd edition, John Wiley & Sons, 2004.

BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

- BIERENS, H.J. *Cointegration Analysis*. Jan/2006. Disponível em: <http://econ.la.psu.edu/~hbierens/COINT.PDF>.
- BROOKS, C. *Introductory econometrics for finance*. Cambridge University Press, 2002.
- BUENO, R.de L. da S. *Econometria de Séries Temporais*. Thomson-Learning, 2008.
- GREENE, W.H. *Econometric Analysis*, MacMillan, 1993.
- GUJARATI, D.N. *Basic Econometrics*, McGraw-Hill, 1995.
- HAMILTON, J.D. *Time Series Analysis*, Princeton University Press, 1994.
- KIM, H. *Hoddrick-Prescott Filter*, 2004. <http://business.auburn.edu/~hzk0001/hpfilter.pdf>
- KMENTA, J. *Elementos de Econometria*, 2a edição, Atlas, 1988.
- MADDALA, G.S. *Introduction to Econometrics*. 2nd edition, Prentice-Hall, 1992.
- PINDYCK, R.S. & RUBINFELD, D. L. *Econometric Models and Economic Forecasts*, 3rd edition, McGraw-Hill, 1991.
- SPANOS, A. The 'Pre-eminence of Theory' versus the 'General-to-Specific' Cointegrated VAR perspectives in Macro-econometric modeling. *Economics Discussion Papers*, 2008-25, Jun/2008. Disponível em: <http://www.economics-ejournal.org/economics/discussionpapers>.

CONTEUDO PROGRAMATICO

1. Operador Defasagem, Operador Diferença, Processos Estocásticos, Estacionariedade.
2. Modelos ARIMA e Testes de Raiz Unitária (ADF, KPSS, PP)
3. Séries de Tempo Multivariadas (introdução aos modelos de equações simultâneas, VAR, Testes de Causalidade, Exogeneidade)
4. Modelos ARCH (ARCH, GARCH (1,1,))
5. Co-Integração (Regressões Espúrias, Teorema de Engle Granger, Metodologia de Johansen)