

UNIVERSIDADE FEDERAL DO ESPÍRITO SANTO CENTRO DE CIÊNCIAS JURÍDICAS E ECONÔMICAS PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA

PLANO DE TRABALHO

DISCIPLINA				CRÉDITOS	CARGA HORÁRIA	OBRIGATÓRIA/ OPTATIVA
CÓDIGO	NOME					
PECO-5044						
PECO-6044	Econometria II			4	60 h	Optativa
Ano letivo 2023		Período letivo	2022/2			
Horários	4ª feira – 14h às 18h	Data de início	16/08/2023	Data de término		Até 16/12/2023
Professor: Dr.	Guilherme Armando de Al	meida Pereira	E-mail: guilher	me.aa.pereira(<u>@ufes.br</u>	

EMENTA

Processos estocásticos comuns em economia. Introdução aos modelos de séries temporais e suas propriedades dinâmicas. Modelos univariados: modelos ARIMA e extensões. Análise de estacionaridade e raiz unitária. Modelos multivariados: VAR/VECM.Função de resposta ao impulso.Cointegração. Introdução aos modelos de volatilidade: ARCH-GARCH. Estimação, inferência, ciclo de modelagem e previsão em modelos de séries temporais.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

Parte 0 - Introdução aos modelos de séries temporais.

- Definições.
- Propriedades dinâmicas.
- Estacionaridade e raiz unitária.
- Função impulso resposta.
- Regressão em séries temporais.

Parte 1 - Modelos univariados: ARIMA e suas extensões.

- Estimação.
- Inferência.
- Previsão.

Parte 2 – Modelos multivariados: VAR/VECM.

- Estimação, inferência, testes de causalidade, ciclo de modelagem, interpretação da função resposta ao impulso e previsão.
- VAR e cointegração.
- Parte 3 Introdução aos modelos de volatilidade: ARCH-GARCH.
 - Estimação, interpretação.

METODOLOGIA

Aulas expositivas teóricas e práticas no R.

AVALIAÇÃO

Duas provas e listas de exercícios. As provas correspondem à 80% da nota final enquanto as listas equivalem à 20%. Alunos com nota maior ou igual a 6 serão aprovados.

REFERÊNCIAS BIBLIOGRÁFICAS

ENDERS, W. (2004). Applied econometric time series. Hoboken: John Wiley & Sons.

HAMILTON, J.D. (1994). Time Series Analysis. Princeton University Press.

HENDRY, D.F. (1995). Dynamic Econometrics. Oxford University Press.

HAYASHI, F. (2000). Econometrics. Princeton University Press.



UNIVERSIDADE FEDERAL DO ESPÍRITO SANTO CENTRO DE CIÊNCIAS JURÍDICAS E ECONÔMICAS PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA

WOOLDRIDGE, J.M. (2002). Econometrics Analysis of Cross-Section and Panel Data. The MIT Press.

JUSELIUS, K. (2006). The cointegrated VAR model: methodology and applications. Oxford University Press.

LÜTKEPOHL, H. (2005) New introduction to multiple time series analysis. SpringerVerlag.

MADDALA, G.S., Kim, I.M. (1998). Unit roots, cointegration and structural change. Cambridge University Press.

SHUMWAY, R.H. and STOFFER, D.S. (2017). Time Series Analysis and Its Applications - With R Examples. Springer.

TSAY, R.S. (2010). Analysis of Financial Time Series. Wiley Series in Probability and Statistics.

. (2013). Multivariate Time Series Analysis: With R and Financial Applications. Wiley Series in Probability and Statistics.