



Disciplina: Econometria II

Carga Horária: 60 horas

Créditos: 4

Natureza: Optativa

Ementa: Desenvolver o estudo de técnicas econométricas para painel de dados e série de tempo. Dados em painel: painel estático, painel dinâmico, cointegração em painel. Série de tempo: processos estocásticos; estacionariedade; modelos ARIMA, raiz unitária; filtro de Kalman; Modelo Autorregressivo; Defasagens distribuídas; VAR e VEC.

Conteúdo Programático:

Processo estocástico e série temporal

Modelos univariados de séries temporais - box-jenkins (arima)

Modelo de estado-espço e filtro de kalman

Modelos multivariados

Painel de dados linear

Painel de dados dinâmico

Painel de dados não linear

Cointegração em painel de dados

Bibliografia:

BARROS, A. C et. Al. Análise de séries temporais em R: um curso introdutório. Org. Pedro Guilherme Costa Ferreira - 1. ed. São Paulo: Atlas Ltda., FGV IBRE, 2020.

BOX, G. E. P.; JENKINS, G. M. & REINSEL, G. C. Time Series Analysis: Forecasting and Control. 3. ed., New Jersey: Prentice-Hall, Inc., 1994.

BUENO, R. de L. da S. Econometria de Séries Temporais. 2. ed., São Paulo: Cengage Learning, 2011.

ENDERS, W. Applied econometric time series. 3 ed. Hoboken, USA: Wiley, 2010.

HAMILTON, J. D. Time series analysis. Princeton, USA: Princeton University Press, 1994.

MORETIN, P. A; TOLOI, C. M. C. Análise de séries tmeporias. 2. ed. São Paulo, SP: Edgard Clucher, 2006.

NELSON, D. R. Applied time series analysis. São Francisco: Holden-Day, Inc., 1973.

ROSSI, J. W.; NEVES. C. Econometria e Séries Temporais com aplicações a Dados da Economia Brasileira. Rio de Janeiro: LTC LTDA. 2014.

CAMERON, A. Colin; TRIVEDI, Pravin K. Microeconometrics: methods and applications. Cambridge University Press, 2005.

WOOLDRIDGE, J.M. Econometric Analysis of Cron Section and Panel Data. MIT Press. 2002.