

Disciplina: Econometria II

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.