

CURSO: Graduação em Economia – 2º semestre de 2022

DISCIPLINA: Econometria II

PROFESSOR: João Victor Issler

CARGA HORÁRIA: 60h

PRÉ-REQUISITO: Econometria I

HORÁRIO E SALA DE ATENDIMENTO: 1h após as aulas de terça e quinta (*office hours*).

SALA: 1014

COMPLEMENTAÇÃO DE CARGA HORÁRIA: 1 aula de 1h40min

PLANO DE ENSINO

1. Ementa

Revisão Equações em Diferenças de 1ª e 2ª Ordem; Modelos estacionários univariados e causais; Modelos ARMA; Autoregressive Distributed Lag Models – ADL; Estimação e testes de diagnóstico; Modelos não estacionários univariados; Passeio aleatório (random walk); Series com tendência determinística; Teste de raiz unitária; Aplicações; Modelos estacionários multivariados; Modelo Vetorial Auto-Regressivo (VAR); Modelos VAR estrutural e reduzido; Estimação e diagnóstico; Função de resposta à impulsos e decomposição de variância do erro de previsão; Modelos não estacionários multivariados; Cointegração: Teorema da Representação de Granger; Introdução aos testes de cointegração; Tópicos Extras: Modelos ARCH, GARCH; Método Generalizado dos Momentos (MGM).

2. Objetivos da disciplina

O principal objetivo da disciplina é apresentar ao aluno conceitos e ferramentas econométricas associadas aos modelos de séries temporais univariados e multivariados usados nas diferentes aplicações econômicas e financeiras, com seus fundamentos teóricos e implementação em softwares específicos (Eviews).

3. Objetivos centrais de aprendizagem

Dotar o aluno de ferramentas específicas de séries temporais teóricas e aplicadas.

4. Relação da disciplina com o debate contemporâneo

Capacidade de entender a dinâmica de processos econômicos, prevendo-os.

5. Procedimentos de ensino (metodologia)

Aulas teóricas com aplicações em computador em sala, além de monitoria com viés aplicado.

6. Conteúdo programático detalhado

Datas	Tópico	Atividades
2/8	Séries Temporais – Conceitos básicos	
4/8	Modelos ARMA – MA, AR e ARMA	
9/8	Modelos ARMA – Eqs. Yule-Walker	
11/8	Modelos ARMA – Teorema de Wold	
16/8	Modelos ARMA – Teorema de Wold	
18/8	Modelos ARMA – Verossimilhança	
23/8	Previsão usando Modelos ARMA	
25/8	Previsão usando Modelos ARMA	
30/8	Modelos ARCH – básico	
1/9	Modelos (G)ARCH como Modelo ARMA	
6/9	Modelos (G)ARCH – Teoria e Estimação	
8/9	Volatilidade Estocástica	
15/9	Aplicações a modelagem de risco	
20 e 22/9	Semana de A1	
27/9	Modelos VAR – básico	
29/9	Modelos VAR – estimação	
4/10	Modelos VAR – estimação	
6/10	Modelos VAR Estruturais vs Forma Reduzida	
11/10	Modelos VAR Estruturais vs Forma Reduzida	
13/10	Modelos VAR – Aplicações	
18/10	Modelos VAR – Aplicações	
20/10	Raiz Unitária e Tendência Estocástica	
25/10	Raiz Unitária e Tendência Estocástica	
27/10	Tendência Linear Determinística	
1/11	Tendência Linear Determinística	
3/11	Testes de Raiz Unitária	
10/11	Modelos VAR com Cointegração	
17/11	Modelos VAR com Cointegração: exemplos	
22 e 24/11	Semana de A2	
29/11	Revisão de Nota	
13 e 15/12	Semana de AS	

7. Procedimentos de avaliação

30% da nota da prova A1, 30% da nota da prova A2, 30% da nota do trabalho empírico, 10% listas de exercício.

8. Bibliografia Obrigatória

ENDERS, Walter. *Applied Econometric Time Series*, Wiley; 3rd edition, 2009.

GREENE, W. *Econometric Analysis*. Prentice Hall, 2003.

BUENO, R. L. *Econometria de Séries Temporais*. 2ª edição, Cengage Learning, 2012.

HAMILTON, James. *Time Series Analysis*, Princeton: Princeton University Press (H).

9. Bibliografia Complementar

COCHRANE, J. *Asset Pricing*. Princeton University Press, 2001.

WOOLDRIDGE, J. *Introdução à Econometria: Uma Abordagem Moderna*. Thomson, 4ª edição, 2011.

DAVIDSON, R., and MACKINNON, J. *Econometric Theory and Methods*. Oxford University Press, 2004.

MOURA, R.; SOUZA, R. et al. *Estatística: Questões comentadas das provas dos concursos de 2003 a 2012 (Questões Anpec)*, 2ª edição, 2012.

SOARES, I.G. e CASTELAR, I. *Econometria Aplicada com o uso do EViews*. Livro Técnico, 2004.

WOOLDRIDGE, J. *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*. The MIT Press, 2001.

10. Minicurrículo do(s) Professor(s)

Possui graduação em Economia pela Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro (1982), mestrado em Economia pela Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro (1987) e Ph.D. in Economics pela University of California, San Diego (1993). Atua nas áreas de Econometria, Macroeconomia, Finanças e Desenvolvimento. É pesquisador 1A do CNPq e Cientista do Nosso Estado, pela FAPERJ. Foi Co-Editor do número especial de 2006 do Journal of Econometrics sobre Common Features e do número especial de 2011 sobre Forecasting. Recebeu da ANPEC o Prêmio Haralambos Simeonidis para Teses de Doutorado, em 1993, e o mesmo Prêmio, em 2004, na categoria Artigos Científicos. É coordenador do Instituto Nacional de Ciência e Tecnologia (INCT) de Educação, Desenvolvimento e Inserção Social, e é também o responsável por notórios estudos brasileiros sobre produção e citação científica em Economia.

10. Link para o Currículo Lattes

http://buscatextual.cnpq.br/buscatextual/visualizacv.do?jsessionid=192E85357AE9D4DD384F10C35BD7595C.buscatextual_0