

PÓS-GRADUAÇÃO – Ementa de disciplina  
Mestrado e Doutorado em Economia

DISCIPLINA: Econometria I  SIGLA: ECO	CÓDIGO: MDPEEC005
PROFESSOR: João Victor Issler	CARGA HORÁRIA: 40h  CRÉDITOS: 4
OBRIGATORIA: <input checked="" type="checkbox"/> SIM <input type="checkbox"/> NÃO	CURSO: <input type="checkbox"/> M <input type="checkbox"/> D <input checked="" type="checkbox"/> MD
PRÉ-REQUISITO:	
ÁREA DE CONCENTRAÇÃO: ESTATÍSTICA E ECONOMETRIA	
<p>EMENTA</p> <p><b>Curso de Econometria I</b></p> <p><b>1. Método Generalizado dos Momentos</b> (*H cap. 14, DM cap. 7)</p> <p>(a) Introdução. (b) Matriz de Ponderação Ótima. (c) Robustez - Estimando Long-Run Variances: a Correção de Newey-West. (d) Teste T x J. (e) Aplicações.</p> <p><b>2. Introdução a Séries Temporais</b> (versão rápida, *H caps 3, 4, 5, 13, 21 e 22, GN caps 1, 3, 4 e 5)</p> <p>(a) Modelos ARMA estacionários e Previsão. (b) Estimção por Máxima Verossimilhança e testes de diagnóstico. (c) Testes de raiz unitária. (d) ARCH. (e) Space-State Representation e o Filtro de Kalman.</p> <p><b>3. Modelos VAR - Autorregressões Vetoriais (*H cap 11, *E, cap 5, DM cap 19)</b></p> <p>(a) Estimção e diagnóstico. (b) Causalidade no sentido de Granger. (c) Modelos Estruturais: modelos triangulares, restrições de coeficientes, e técnica de Blanchard-Quah. (d) Função de resposta a impulso e decomposição de variância do erro de previsão.</p>	

**4. Introdução a Cointegração**

(\*H caps 15, 17, 18, 19 e 20, DM cap 20, dependendo da disponibilidade de tempo)

- (a) Raiz Unitária e Cointegração.
- (b) Teorema da Representação de Granger.
- (c) Introdução aos testes de cointegração.

**5. Introdução a Econometria de Dados de Painel usando Modelos Lineares**

(\*W caps 7 e 10)

- (a) Pooled OLS.
- (b) Heterogeneidade não observada: Efeitos Fixos vs. Efeitos Aleatórios.
- (c) Modelos de painel dinâmico: técnicas de variáveis instrumentais usando GMM - Arellano e Bond e Blundell e Bond.

**Avaliação**

Serão considerados os seguintes pesos na composição da nota final, 60% para a prova final, 30% para a primeira prova e 10% na lista de exercícios.

**OBJETIVOS**

**BIBLIOGRAFIA**

**Livros-Texto<sup>1</sup>:**

Davidson, R. e McKinnon, J., 2003, "Econometric Theory and Methods," New York: Oxford University Press (DM).

Granger, C.W.J. e Newbold, P., 1986, "Forecasting Economic Time Series," San Diego: Academic Press 2a. Edição (GN).

Hamilton, J.D., 1994, "Time Series Analysis", Princeton: Princeton University Press (H).

Wooldridge, J., 2002, "Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data," Cambridge: The MIT Press (W).

Enders, W., 2003, "Applied Econometric Time Series," New York: Wiley Publishers, 2a. Edição (E). Trata-se de um livro de apoio para a implementação da parte empírica.

<sup>1</sup> Indica leitura obrigatória