
CURSO: Graduação em Economia – 2º semestre de 2019
DISCIPLINA: Econometria II
PROFESSOR(ES): João Victor Issler
CARGA HORÁRIA: 60h
PRÉ-REQUISITO: Econometria I
HORÁRIO E SALA DE ATENDIMENTO: 3as e 5as das 15-17.
SALA: 1111

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; Estimção 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; Estimção 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
06/08	Séries Temporais – Conceitos básicos
08/08	Modelos ARMA – MA, AR e ARMA
13/08	Modelos ARMA – Eqs. Yule-Walker
15/08	Modelos ARMA – Teorema de Wold
20/08	Modelos ARMA – Teorema de Wold
22/08	Modelos ARMA – Verossimilhança
27/08	Previsão usando Modelos ARMA
29/08	Previsão usando Modelos ARMA
03/09	Modelos ARCH – básico
05/09	Modelos (G)ARCH como Modelo ARMA
10/09	Modelos (G)ARCH – Teoria e Estimação
12/09	Não haverá aula – evento Lubramacro
17/09	Volatilidade Estocástica
19/09	Aplicações a modelagem de risco
21 a 28/09	Semana de A1 e Prova da ANPEC na FGV 25 e 26/9
01/10	Modelos VAR – básico
03/10	Modelos VAR – estimação
08/10	Modelos VAR Estruturais vs Forma Reduzida
10/10	Modelos VAR Estruturais vs Forma Reduzida
15/10	Dia do Professor – Não haverá aula
17/10	Modelos VAR Estruturais vs Forma Reduzida
22/10	Modelos VAR – Aplicações
29/10	Modelos VAR – Aplicações
31/10	Raiz Unitária e Tendência Estocástica
05/11	Tendência Linear Determinística
07/11	Testes de Raiz Unitária
12/11	Modelos VAR com Cointegração
14/11	Modelos VAR com Cointegração: exemplos
18 a 27/11	Semana de A2
03/12	Revisão de Nota
07 a 14/12	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.

9. Bibliografia Complementar

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

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

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

GRANGER, C.W.J. e NEWBOLD, P., 1986, "Forecasting Economic Time Series," Academic Press 2a. Ed.

10. Mini Currículo do Professor

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, 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 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?id=K4781886P8>