
CURSO: Graduação em Economia – 2º semestre de 2020
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	Atividades
04/08	Séries Temporais – Conceitos básicos	
06/08	Modelos ARMA – MA, AR e ARMA	
11/08	Modelos ARMA – Eqs. Yule-Walker	
13/08	Modelos ARMA – Teorema de Wold	
18/08	Modelos ARMA – Teorema de Wold	
20/08	Modelos ARMA – Verossimilhança	
25/08	Previsão usando Modelos ARMA	
27/08	Previsão usando Modelos ARMA	
01/09	Modelos ARCH – básico	
03/09	Modelos (G)ARCH como Modelo ARMA	
08/09	Modelos (G)ARCH – Teoria e Estimação	
10/09	Volatilidade Estocástica	
15/09	Aplicações a modelagem de risco	
17/09	Aplicações a modelagem de risco	
19 a 26/09	Semana de A1	
29/09	Modelos VAR – básico	
01/10	Modelos VAR – estimação	
06/10	Modelos VAR Estruturais vs Forma Reduzida	
08/10	Modelos VAR Estruturais vs Forma Reduzida	
13/10	Modelos VAR Estruturais vs Forma Reduzida	
15/10	Dia do Mestre - feriado	
20/10	Modelos VAR – Aplicações	
22/10	Modelos VAR – Aplicações	
27/10	Raiz Unitária e Tendência Estocástica	
29/10	Raiz Unitária e Tendência Estocástica	
03/11	Tendência Linear Determinística	
05/11	Tendência Linear Determinística	
10/11	Tendência Linear Determinística	
12/11	Testes de Raiz Unitária	
17/11	Testes de Raiz Unitária	
19/11	Modelos VAR com Cointegração	
24/11	Modelos VAR com Cointegração: exemplos	
26/11	Revisão	
30/11 a 07/12	Semana de A2	
	Revisão de Nota	
	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>