



MACROECONOMETRIA E ECONOMETRIA FINANCEIRA

INSTITUTO BRASILEIRO DE ENSINO, DESENVOLVIMENTO E PESQUISA **Ementa do Curso**

ENSINO,

DESENVOLVIMENTO E

PESQUISA

PROGRAMA DE

PÓS-GRADUAÇÃO

STRICTO SENSU

EM ECONOMIA

Estacionariedade em séries de tempo. O modelo Média Móvel (MA). O modelo Autorregressivo (AR). O modelo ARMA com e sem sazonalidade: estimação e projeções. Identificação, seleção e diagnóstico de modelos. Processos não estacionários, tendência estocástica e regressão espúria. Testes de raiz unitária. O modelo de vetores autorregressivos: diagnóstico, projeções e função impulso-resposta com restrições de curto e longo prazo. Cointegração e o modelo com mecanismo de correção de erros (VECM). Volatilidade e os modelos ARCH/GARCH

Objetivos do Curso

Ao final do curso, os alunos deverão estar familiarizados com o método de análise de redes e capazes de aplicá-lo em problemas de pesquisa, seja na área de administração pública ou na área de economia (inclusive complexidade econômica).

Carga Horária: 40h

Créditos: 02

Categoria: Optativa

LEITURAS OBRIGATÓRIAS

ENDERS, W. *Applied Econometric Time Series*. Wiley, 4^a ed., 2014.

GUJARATI, D. N.; PORTER, D. C. *Econometria Básica*. AMGH, 2011.

HAMILTON, J. D. *Time Series Analysis*. Princeton University Press, 1994.

LÜTKEPOHL, H. *New Introduction to Multiple Time Series Analysis*. Springer, 2005.

PESARAN, M. H.; SMITH, R. *Econometrics of Panel Data and Time Series*. Palgrave, 2015.

STOCK, J. H.; WATSON, M. W. *Introduction to Econometrics*. Pearson, 4^a ed., 2020.

TSAY, R. S. *Analysis of Financial Time Series*. Wiley, 3^a ed., 2010.

LEITURAS COMPLEMENTARES

Bollerslev, T. (1986). "Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity." *Journal of Econometrics*.

Engle, R. F. (1982). "Autoregressive Conditional Heteroskedasticity with Estimates of the Variance of United Kingdom Inflation." *Econometrica*.

Johansen, S. (1988). "Statistical Analysis of Cointegration Vectors." *Journal of Economic Dynamics and Control*.

Kilian, L.; Lütkepohl, H. (2017). *Structural Vector Autoregressive Analysis*. Cambridge University Press.

Sims, C. A. (1980). "Macroeconomics and Reality." *Econometrica*.
