



MACROECONOMETRIA E ECONOMETRIA FINANCEIRA

INSTITUTO BRASILEIRO DE ENSINO,

DESENVOLVIMENTO E PESQUISA

PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO STRICTO SENSU EM ECONOMIA

Ementa do Curso

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, 4ª 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, 4ª ed., 2020.

TSAY, R. S. Analysis of Financial Time Series. Wiley, 3ª 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.
