

idp

MACROECONOMETRIA

INSTITUTO BRASILEIRO DE Ementa do Curso

ENSINO,

DESENVOLVIMENTO E

PESQUISA

PROGRAMA DE

PÓS-GRADUAÇÃO

STRICTO SENSU

EM ECONOMIA

Natureza dos dados de séries temporais. Exemplos de modelos de regressão de séries temporais. Séries temporais estacionárias e não-estacionárias. Processos Estocásticos. Modelos úteis em séries temporais: processo aleatório, autorregressivo e de média móvel. Abordagem Box-Jenkins. Teste de estacionariedade. Testes de Raízes Unitárias (sem e com quebra estrutural). Cointegração. Testes de Cointegração (sem e com quebra estrutural). Causalidade de Granger. Modelos Autorregressivos e de Defasagens Distribuídas (Modelos ADL). Causalidade de Granger em Modelos ADL. Modelos VAR e VEC. Funções de Impulso-Resposta, Causalidade de Granger e Decomposição da Variância dos Erros de Previsão em modelos VAR/VEC. Modelos ARCH e GARCH. Previsão em séries temporais. Combinação de Previsões.

Objetivos do Curso

Carga Horária: 40h

O objetivo geral da disciplina é desenvolver os conceitos principais da análise de séries temporais nos fenômenos macroeconômicos.

Créditos: 02

A disciplina tem como objetivos específicos preparar o aluno com o ferramental econométrico para descrever o comportamento de series econômicas, além de permitir ao aluno noções básicas de previsão econômica.

Categoria: Optativa

Esse curso cobre os métodos básicos e a moderna teoria de séries temporais, ao mesmo tempo em que fornece uma base para pesquisas aplicadas. O estudante irá adquirir conhecimentos relevantes e necessários para ser capaz de entender a literatura econométrica teórica e empírica, como exposta nos journals e livros-textos, referente às séries temporais.

Assim, deve-se 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.



BIBLIOGRAFIA

ENDERS, Walter. *Applied Econometric Time Series*. 4th Edition. 2015.

HAMILTON, James Douglas. *Time Series Analysis*. 1st Edition. Princeton University Press, 2020.

GUJARATI, Damodar N.; PORTER, Dawn C. *Econometria Básica*. 5ª edição. Amgh Editora, 2011.
