



Programa da Disciplina

Nome: EA008 – ECONOMETRIA II

Natureza: Eletiva

CH: 30 Horas

Créditos: 2

Ementa: O objetivo do curso é apresentar modelos lineares de séries temporais univariadas e multivariadas com forte abordagem teórica e prática. Dentro deste último escopo, serão desenvolvidas, durante o curso, aplicações das técnicas utilizando dados econômicos ou financeiros.

CONTEÚDO PROGRAMÁTICO

1. Processos Estocásticos
2. Modelos ARMA
3. Raízes Unitárias e Processos Integrados
4. Análise Espectral e Processos Fracionários
5. Vetores Auto Regressivos e Vetor de Correção de Erros
6. Cointegração.

AVALIAÇÃO

Provas e listas de exercícios.

BIBLIOGRAFIA

Bibliografia Básica:

Wei, William W.S., **Time Series Analysis: Univariate and Multivariate Methods**, 2nd ed., Pearson Addison Wesley, 2006

Hamilton, J. **Time Series Analysis**. Princeton University Press, 1994.

Palma, Wilfredo, **Long-Memory Time Series: Theory and Methods**, Willey, 2007.

Bueno, Rodrigo D.L.S., **Econometria de séries temporais**, 2º ed., Cengage, 2012.

Bibliografia Complementar:

Moretín , Pedro A., Toloi, Clélia M. C., **Análise de Séries Temporais - 2ª ed.**, Edgard Blucher, 2006

Enders, Wlater, **Applied Econometric Times Series**, 3rd ed. 2009

Cryer. J.D, Chan, K.S., **Time Series Analysis: With Applications in R, Springer Texts in Statistics**, 2nd ed., 2010