

O curso oferece uma introdução aos fundamentos da análise de séries de tempo e suas principais aplicações. A literatura sobre a aplicação de métodos econométricos a dados macroeconômicos cresceu de forma dramática nas últimas décadas, o que nos força a fazer escolhas sobre quais tópicos abordar e o grau de aprofundamento técnico dedicado a cada assunto. O objetivo é prover o instrumental necessário para o trabalho empírico em macroeconomia, capacitando os alunos e alunas em economia aplicada.

Avaliação: A avaliação consistirá de exercícios empíricos e um trabalho final, com tópico e metodologia acordados com o professor.

1. Conceitos e modelos utilizados em séries temporais: estacionaridade, exogeneidade, estacionaridade estrita, ergodicidade
2. Estimação e inferência
 - a. O estimador de máxima verossimilhança
 - b. Inferência baseada em MV
3. Estimação de efeitos causais dinâmicos
 - a. Modelos de defasagens distribuídas e de vetores autorregressivos
 - b. VAR estrutural, identificação e inferência causal
4. Testes de raiz unitária e modelos com dados não estacionários
 - a. ARIMA, VARMA
 - b. Cointegração e modelos de correção de erros
5. Estimação consistente: Método dos Momentos Generalizados (GMM)
 - a. Estimação baseada em condições de ortogonalidade
 - b. Propriedades do estimador GMM
 - c. Inferência: teste de validade das restrições de momentos, testes equivalentes ao Wald, MV e razão de verossimilhança

O curso baseia-se em diversos livros e textos. No entanto, os livros principais são Hamilton (1994) e Martin (2013).

Referências:

Bueno, Rodrigo De Losso da Silveira (2012). Econometria de Séries Temporais (2ª Edição)

Enders, Walter (2010). Applied Econometric Time Series (3ª Edição)

Hamilton, James (1994). Time Series Analysis.

Hayashi, Fumio (2000). Econometrics

Lutkepohl, Helmut (2005). New Introduction to Multiple Time Series Analysis

Lutkepohl, Helmut and Markus Kratzig (Ed). (2004). Applied Time Series Econometrics

Martin, Vance, Stan Hurn and David Harris (2013). Econometric Modeling with Time Series: Specification, Estimation and Testing.

Paterson, Kerry (2000). An Introduction to Applied Econometrics: a time series approach.

Verbeek, M. (2004). A Guide to Modern Econometrics.