

### **Objetivo:**

Apresentar as ferramentas econométricas básicas para análise de séries de tempo para análise empírica para modelos de previsão e modelagem univariados e multivariados.

### **Programa:**

- 1 Propriedades estatísticas de séries de tempo
- 2 Modelos Univariados para séries de tempo – ARIMA
- 3 Testes de Raízes Unitárias
- 4 Modelos com sazonalidade
- 5 Princípios de previsão
- 6 Modelos Multivariados de Séries de Tempo – VAR
- 7 Cointegração – ECM, VECM
- 8 Dados em painel com T grande: estimação e cointegração

### **Avaliação**

Média baseada em duas provas (40%) e três trabalhos empíricos (60%).

### **Bibliografia Básica:**

BUENO, R. L. Econometria de Séries de Tempo, 2ª Ed. Cengage Learning, 2011.

ENDERS, W. Applied Econometric Time Series, 3rd edition Wiley Series in Probability and Statistics. New York: Willey, 2010 [livro texto básico]

HAMILTON, J. Time Series Analysis. Princeton, PUP.

VERBEEK, M. Modern Applied Econometrics, 2nd Ed.. Willey, 2004