

UERJ EMENTA DA DISCIPLINA

UNIDADE ACADEMICA **Faculdade de Ciências Econômicas**

DEPARTAMENTO **DAQ**

CÓDIGO

NOME DA DISCIPLINA **Econometria II**

(x) obrigatória

(x) eletiva

CH 60

CRÉD 04

PROGRAMA DISTRIBUIÇÃO DE CARGA HORÁRIA Pós-Graduação Ciências Econômicas

TIPO DE AULA	C. HORÁRIA	Nº CRÉDITOS
--------------	------------	-------------

CURSO TEÓRICA	60	04
---------------	----	----

Mestrado

PRÁTICA - -

Doutorado	60	04
-----------	----	----

PRÉ-REQUISITO: Econometria I CÓDIGO EMENTA

1) Introdução Modelagem de Séries Temporais:

a) Processos ARMA estacionários;

b) Testes de estacionariedade e raiz unitária, sem e com quebra estrutural.

2) Filtro de Kalman:

a) espaço de estados

b) estimador de máxima verossimilhança.

3) Modelos univariados de séries temporais:

a) Metodologia Box-Jenkins,

b) Modelos ARIMA e SARIMA,

c) Modelos estruturais com e sem quebras estruturais,

d) Previsão.

4) Modelos Multivariados de Séries Temporais tipo ADL, VAR, SVAR

5) Modelos de correção de erros (VEC):

a) cointegração - conceito e testes.

b) Estimação.

c) Modelos VEC estruturais.

6) Modelos VAR e VEC com abordagem Bayesiana.

BIBLIOGRAFIA BASICA

- 1) Stock, James H e Watson, Mark M. 2010. Introduction to Econometrics. Pearson Education Inc. 3a. edição.
- 2) Rudd, Paul A. 2000. An Introduction to Classical Econometric Theory. Oxford University Press. New York.
- 3) Wooldridge, Jeffrey M. 2009. Introductory Econometrics: A Modern Approach. South Western Cengage Learning. Mason, OH - USA.
- 4) Enders, Walter. 2009. Applied Econometric Time Series. Wiley Series in Probability and Statistics. 3a. edição.
- 5) Hamilton, James D. 1994. Time Series Analysis. Princeton University Press.
- 6) Harvey, A. C. 1993. Time Series Models. The MIT Press. 2a. Edição.
- 7) Harvey, A. C. 1989. Forecasting, Structural Time Series Models and the Kalman Filter. Cambridge University Press.
- 8) Lütkepohl, Helmut. 2006. New Introduction to Multiple Time Series. Springer Berlin Heidelberg.

16) PROFESSOR PROPONENTE
DATA ASSINATURA/MAT.

3

3

3

3


COORDENADOR DO PROGRAMA
DATA ASSINATURA/MAT.