



**MINISTÉRIO DA EDUCAÇÃO
UNIVERSIDADE FEDERAL DE PELOTAS
PRÓ REITORIA DE PESQUISA E PÓS GRADUAÇÃO**

PROGRAMA ANALÍTICO E EMENTA DE DISCIPLINA DA PÓS GRADUAÇÃO

IDENTIFICAÇÃO						
Disciplina Econometria II					Código	
Departamento Economia					Sigla da Unidade	
Professor Responsável pela Disciplina Regis Augusto Ely					Matrícula do SIAPE 1882041	
Outros Professores Envolvidos Felipe Garcia Ribeiro					1857248	
Semestre Letivo	Duração em Semanas	Carga Horária Semanal				Carga Horária Total
		4				68
I () II (X)	17	Teóricas 4	Exercício 0	Prática 0	Total 4	Número de Créditos 4
Pré-Requisitos						
Econometria						

EMENTA	
Modelos Lineares de Equação Única. Modelos Lineares de Sistema de Equações. Modelos Básicos de dados em Pannel. Modelos Não-Linearares e Tópicos Relacionados. Processos estocásticos. Processos ARIMA. Identificação. Estimção. Diagnóstico. Previsão. Vetores autorregressivos. Raiz unitária e cointegração. Heteroscedasticidade condicional.	
CURSOS PARA OS QUAIS É MINISTRADA	
1. Mestrado em Organizações e Mercados 2. 3. 4. 5. 6.	(OA) ¹ () () () () ()
Obs. 1 = (OA) Obrigatória (OP) Optativa (AC) Área de Concentração (DC) Área de Domínio Conexo	

____/____/____ Data		_____ Assinatura do Responsável pela disciplina
APROVAÇÃO		
Departamento		
____/____/____ Data		_____ Assinatura do Chefe do Depto e carimbo
COCEPE		
____/____ Nº da Ata da Reunião	____/____/____ Data da Aprovação	_____ Assinatura do Diretor Departamento de Pós Graduação e carimbo



**MINISTÉRIO DA EDUCAÇÃO
UNIVERSIDADE FEDERAL DE PELOTAS
PRÓ REITORIA DE PESQUISA E PÓS GRADUAÇÃO**

PLANO DE ENSINO

Objetivo: Este curso visa apresentar métodos avançados em econometria, seus fundamentos e sua importância com relação à pesquisa científica. Procura-se apresentar os fundamentos teóricos das técnicas econométricas com apoio de aplicações empíricas.

PROGRAMA ANALÍTICO	
Unidades e Assuntos	Nº de Horas Aulas
1) MODELOS LINEARES DE EQUAÇÃO ÚNICA a) Revisão b) Estimação por OLS c) Estimação por IV e 2SLS	6
2) MODELOS NÃO-LINEARES E TÓPICOS RELACIONADOS a) Modelos de resposta binária: Probit e Logit b) Dados de Contagem	8
3) MODELOS BÁSICOS DE DADOS EM PAINEL a) Pooled OLS b) Random Effects Methods c) Fixed Effects Methods d) First Differencing Methods e) Comparison of Estimators	10
4) TÓPICOS AVANÇADOS EM PAINEL b) Seleção Amostral, Atrito e Amostragem estratificada c) Dados contáveis e modelos relacionados	8
5) PROCESSOS ESTOCÁSTICOS: a) Processos estocásticos b) Esperança c) Autocovariância d) Estacionariedade e) Ergodicidade f) Ruído branco g) Processos lineares estacionários h) Processos não-estacionários i) Tendência e sazonalidade	6

6) PROCESSOS ARIMA a) Operadores de lag b) Processos de médias móveis c) Processos autorregressivos d) Processos ARMA e) Integração f) Invertibilidade	6
7) METODOLOGIA DE BOX-JENKINS a) Decomposição de Wold b) Identificação c) Estimação d) Diagnóstico e) Previsão	6
8) VETOR AUTORREGRESSIVO a) Processos VAR b) Causalidade de Granger c) Estimação d) Função impulso-resposta e) VAR estrutural f) Exemplos e aplicações	6
9) RAÍZ UNITÁRIA E COINTEGRAÇÃO a) Passeio aleatório e movimento browniano b) Testes para detecção de raiz unitária c) Regressão espúria d) Problema da cointegração e) Testes para cointegração f) Modelo de correção de erros e) Exemplos e aplicações	6
10) MODELOS DE HETEROSCEDASTICIDADE CONDICIONAL a) Modelos ARCH b) Modelos GARCH c) Extensões: EGARCH, GJR-GARCH d) Modelo de volatilidade estocástica e) Outros modelos não-lineares f) Modelos multivariados e cópulas g) Exemplos e aplicações	6
TOTAL DE HORAS AULAS	68

REFERÊNCIAS BIBLIOGRÁFICAS	
Nº de Ordem	Referências Obrigatórias
1	ENDERS, W. (1995), <i>Applied Econometric Time Series</i> , John Wiley & Sons, Nova York.
2	HAMILTON, J. D. (1994), <i>Time Series Analysis</i> , Princeton University Press, Princeton.
3	MORETTIN, P. A.; TOLOI C. M. C. (2006). <i>Análise de Séries Temporais</i> . Editora Blucher, São Paulo. 2º Ed.
4	MORETTIN, P. A. (2008) <i>Econometria Financeira: Um Curso em Séries Temporais Financeiras</i> , Editora Blucher, São Paulo.
	Referências Complementares
5	CAMPBELL, J. Y.; LO, A. W.; MACKINLAY, A. C. (1997), <i>The econometrics of financial</i>

	market, Princeton University Press, Princeton.
6	CASELLA, G.; BERGER, L. (2002), <i>Statistical Inference</i> . Duxbury.
7	DICKEY, D. A. e FULLER, W. A. (1981), "Likelihood Ratio Statistic for Autorregressive Time Series with a Unit Root", <i>Econometrica</i> , 49, 1057-1072.
8	ENGLE, R. F. (1982), "Autoregressive Conditional Heteroskedasticity with Estimates of the variances of U.K. Inflation" <i>Econométrica</i> , vol. 50, n. 4, p. 987-1008.
9	ENGLE, R. F. e GRANGER, C. W. J. (1995), <i>ARCH: Selected Readings</i> , Oxford University Press, Oxford.
10	ENGLE, R. F. e GRANGER, C. W. J. (1987), "Cointegration and Error Correction: Representation, Estimation and Testing", <i>Econometrica</i> , 55, 251-276.
11	ENGLE, R. F. e GRANGER, C. W. J. (1991), <i>Long-Run Economic Relationship: Readings in cointegrations</i> , Oxford University Press, Oxford.
12	FULLER, W. (1976), <i>Introduction to Statistical Time Series</i> , John Wiley and Sons, Nova York.
13	GREENE, W. H. (1999), <i>Econometric Analysis</i> , 3rd edition, Prentice-Hall, New Jersey.
14	JOHANSEN, S. (1988), Statistical Analysis of Cointegration Vectors, <i>Journal of Economic Dynamics and Control</i> , vol. 12, p. 231-254.
15	MADDALA, G. S. e IN-MOO, K. (1998), <i>Unit Roots, Cointegration and Structural Change</i> , Cambridge University Press, Cambridge.
16	NELSON, C. R. e PLOSSER, C. I. (1982), "Trends and Random Walks in Macroeconomic Time Series: Some Evvidence and Empirical Implications", <i>Journal of Monetary conomics</i> , 10, p.139-169.
17	PERRON, P. (1988), "Trends and Random Walks in Macroeconomic Time Series", <i>Journal of Economic Dynamics and Control</i> , 12, 297-332.
18	STOCK, J. H. (1994), "Unit Roots, Structural Breaks and Trends", in R. F. Engle e D. L. McFadden, <i>Handbook of Econometrics</i> , vol IV, p. 2738-2841, North-Holland, Ansterdam.
19	WATSON, M. W. (1994), "Vector Autoregressions and Cointegration", in R. F. Engle e D. L. McFadden, <i>Handbook of Econometrics</i> , vol IV, p. 2843-2915, North-Holland, nsterdam.