DISCIPLINA: Tópico Especial: Econometria de Séries Temporais	**CÓDIGO**: PPGA0021
PROFESSOR: Lucélia Viviane Vaz Raad	

Nível	Mestrado
Caráter	Não obrigatória
Carga Horária	45
Créditos	3
Área de Concentração	Processos e Sistemas Decisórios
Linha de Pesquisa	Processos e Sistemas Decisórios em Arranjos Organizacionais

Ementa

Processos estocásticos estacionários, função de autocorrelação, função de autocorrelação parcial, Processos AR, Processos MA, processos ARMA. Método da máxima verossimilhança. Raíz unitária, processos ARIMA. Cointegração, VAR e VECM. Modelos ARCH, modelos GARCH.

Objetivo

Entender o conceito de estacionariedade e a sua importância para modelagem de séries temporais. Identificar a estacionariedade. Reconhecer processos autorregressivos (AR), processos de média móvel (MA) e processos autorregressivos e de Média Móvel (ARMA). Entender as formas de estimação dos parâmetros de modelos (ARMA). Compreender o que é uma raiz unitária e seus efeitos em termos de modelagem e estimação de modelos do tipo ARMA. Identificar um processo raiz unitária. Construir modelos e por meio deles fazer previsão de séries econômicas e financeiras. Estimar modelos do tipo ARCH, GARCH, VAR e VECM.

Interdisciplinaridade

Pré-requisitos	**Código**
Não tem	
Disciplinas para as quais é pré-requisito	
Não tem	

Unidades de ensino		**Carga-horária Horas**
1	Processos estacionários	10
2	Raiz unitária e processos ARIMA	10
3	Estimação de parâmetros e previsão	7
4	Modelos ARCH e GARCH	8
5	Cointegração, Modelos VAR e VECM	10
	Total	**45**

Bibliografia	
1	BROCKWELL, Peter J.; DAVIS, Richard A.; CALDER, Matthew V. **Introduction to time series and forecasting**. New York: Springer, 2002.
2	HAMILTON, James Douglas. **Time series analysis**. Princeton, NJ: Princeton University Press 1994.
3	WOOLDRIDGE, Jeffrey M. **Introductory econometrics:** a modern approach. Nelson Education 2015.
4	ENDERS, Walter. **Applied econometric time series**. Hoboken: John Wiley & Sons, 2008.
5	
6	
7	
8	
9	
10	
11	
12	
13	
14	
15	
16	
17	
18	