

UNIVERSIDADE DE SÃO PAULO
FACULDADE DE ECONOMIA, ADMINISTRAÇÃO E CONTABILIDADE
DEPARTAMENTO DE ECONOMIA
Campus de Ribeirão Preto

Disciplina: REC2302 – Econometria III

1º. Semestre de 2020

Profa. Dra. Roseli da Silva

Sala 07 – Bloco C1

E-mail: roselisolva@usp.br

Site: randomwalk.com.br

Objetivos

Apresentar os principais métodos que compõem o instrumental voltado para a modelagem univariada e multivariada e para a previsão de séries temporais em economia.

Programa

1. Introdução
 - 1.1 Metodologias de Modelagem Econométrica
 - 1.2 Técnicas de projeção e suavização de séries temporais
 - 1.3 Fundamentos matemáticos - Equações em Diferenças Finitas (Revisão)
2. Modelos Univariados de Séries de Tempo
 - 2.1 Modelos estacionários
 - 2.2 Abordagem de Box-Jenkins
 - 2.3 Modelos não estacionários: Testes de raiz unitária
 - 2.4 Volatilidade: modelos ARCH e suas extensões
3. Modelos Multivariados de Séries de Tempo
 - 3.1 Cointegração Engle-Granger
 - 3.2 Causalidade Granger e Modelos de correção de erros
 - 3.3 Introdução aos modelos Vetor Autorregressivos e Cointegração de Johansen.

Avaliação

Método

Duas avaliações dissertativas individuais (P1 e P2), com pesos iguais a 30%; um trabalho em grupo (TG) de 5 pessoas, a escolha dos alunos, que será desenvolvido **ao longo do semestre** e será entregue em relatório detalhado (50% da nota do trabalho) e apresentado em sala de aula (50% da nota do trabalho), com peso de 30%; quizzes realizados em sala por meio do aplicativo Socrative, cuja média (QM) terá peso de 10% na média final.

Nota final por média ponderada: $0,30 \cdot P1 + 0,30 \cdot P2 + 0,30 \cdot TG + 0,10 \cdot QM$

Critério

Aprovação com nota igual ou superior a 5,0 e mínimo de 70% de frequência.

Norma de Recuperação

Prova teórica de recuperação envolvendo toda a matéria. A nota final para alunos que fizerem a reavaliação será a média simples entre a nota da prova de reavaliação e a média final alcançada antes desta.

Bibliografia

ENDERS, Walter "Applied Econometric Time Series", New York, John Wiley and Sons, 2nd ed. 2004. **(livro-texto)**

BUENO, R. L. S. Econometria de Séries Temporais. 1^a ed. Cengage, 2008.