



Universidade Federal da Bahia
Faculdade de Economia
Programa de Pós-Graduação em Economia
Mestrado e Doutorado em Economia

Disciplina	Nível	Natureza
ECOB19 - Econometria III	Mestrado/ Doutorado	Optativa
Área de Concentração	C. Horária	Créditos
Geral	68	4
Ementa		
Processos estocásticos. Raízes unitárias. Modelos univariados de séries de tempo - enfoque de Box-Jenkins. Modelos de Vetor Auto-regressivo. Causalidade. Análise de cointegração. Exogeneidade. Modelos estruturais para séries de tempo: espaços de estado de filtro de Kalman. Modelos de volatilidade: modelos ARCH e suas extensões e modelos de volatilidade estocástica. Modelos com séries de alta frequência. Modelos não Lineares de Séries de Tempo.		
Bibliografia		
<ol style="list-style-type: none">1. ANDREWS, R. L. (1994) Forecasting performance of structural time series models. <i>Journal of Business and Economic Statistics</i> 12: 129-132.2. BANERJEE, A., DOLADO, J., Galbraith, J. W. & HENDRY, D. F. (1993) Co-integration, error- correction, and the econometric analysis of non-stationary data. Oxford University Press.3. BOLLERSLEV, T., ENGLE, R.F. & NELSON, D.B. (1993) ARCH Models. <i>The Handbook of Econometrics</i>, vol. 4.4. BOX, G.E. & JENKINS, G. M. (1970) <i>Time series analysis: forecasting and control</i>. San Francisco, Holden Day.5. BOX, G.E., JENKINS, G. M. & REINSEL, G. C. (1994) <i>Time series analysis: forecasting and control</i>. Prentice Hall.6. DICKEY, D.A. & FULLER, W.A. (1981) Likelihood ratio statistics for autoregressive time series with a unit root. <i>Econometrica</i> 49(4): 1057-1073.7. DICKEY, D.A. & PANTULA, S. G. (1987) Determining the order of differencing in autoregressive process. <i>Journal of Business and Economic Statistics</i> 15: 455-461.8. ENDERS, W. (2004) <i>Applied Econometric Time Series</i>, John Wiley & Sons, 2a. ed.9. ENGLE, R.F. & GRANGER, C.W.J. (1987) Cointegration and error correction: representation, estimation, and testing. <i>Econometrica</i> 55(2): 251-276.ENGLE, R.F. & YOO, B. S. (1987) Forecasting and testing in cointegrated systems. <i>Journal of Econometrics</i> 35(1): 143-159.10. FAVERO, C. A. (2001) <i>Applied Macroeconometrics</i>. Oxford University Press.11. GRANGER, C.W.G. & NEWBOLD, P. (1974) Spurious regressions in econometrics. <i>Journal of Econometrics</i> 2: 111-120.12. HAMILTON, J.D. (1994) <i>Time series analysis</i>. Princeton University Press.13. HARRIS, R. (1995) <i>Using cointegration analysis in econometric modelling</i>. Prentice Hall.14. HARVEY, A. C. (1993) <i>Time series models</i>. The MIT Press, 2a. edição.15. HARVEY, A. C., RUIZ, E. & SHEPHARD, N. (1994) Multivariate stochastic variance models. <i>Review of Economic Studies</i> 61: 247-264.16. HATANAKA, M. (1996) <i>Time series based econometrics: unit roots and cointegration</i>. Oxford University Press, Oxford.		



Universidade Federal da Bahia
Faculdade de Economia
Programa de Pós-Graduação em Economia
Mestrado e Doutorado em Economia

17. JOHANSEN, S. (1992) Cointegration in partial systems and the efficiency of single-equation analysis. *Jornal of Econometrics* 52 (3): 389-402.
18. NAKANE, M. I. (1993) Testes de exogeneidade fraca e de superexogeneidade para a demanda por moeda no Brasil. Dissertação de Mestrado, IPE/FEA/USP.
19. SPANOS, A. (1986) *Statistical foundations of econometric modelling*. Cambridge University Press.
20. Vandaele, W. (1983) *Applied time series and Box-Jenkins models*. New York: Academic Press.