



UNIVERSIDADE FEDERAL DE SANTA CATARINA
CENTRO SÓCIO-ECONÔMICO
COORDENADORIA DO CURSO DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA – MESTRADO

DISCIPLINA: ECONOMETRIA II – CNM 3339

PROFESSOR: FERNANDO SEABRA

PLANO DE ENSINO

EMENTA: Tópicos de Econometria: Combinação de séries temporais e dados cross-section: modelos de equações simultâneas: modelos Arima: modelos Arch: modelos de regressão multivariada: cointegração e modelos de correção de erro.

Conteúdo Programático

1. Modelos Estocásticos Univariados Lineares: ARMA e ARIMA
Enders, 2
2. Modelos Estocásticos Univariados Não-Lineares: Arch e Tendências
Enders, 3
3. Raízes Unitárias
Enders, 4
4. Séries Temporais Multivariadas: Modelos VAR
Enders, 5
5. Cointegração e Modelos de Correção de Erro
Enders, 6
6. Séries Temporais Não-Lineares
Enders, 7

Referências:

Principal:

Enders, W. (1995) *Applied Econometric Time Series*, New York: John Wiley & Sons, 2nd ed.

Complementares:

Campbell, J. Y.; Lo, A. W. and M. A.C. (1997). *The Econometrics of Financial Markets*. New Jersey: Princeton University Press

Greene, W. H. (1991) *Econometric Analysis*, New York: MacMillan.

Gujarati, D. (2000) *Econometria Básica*, São Paulo: Makron.

Gourieroux, C and Jasiak, J. (2001). *Financial Econometrics*. New Jersey: Princeton University Press

Hill, C., Griffiths, W. and Judge, G. (1999) *Econometria*, São Paulo: Saraiva.

Maddala, G. S. (2003) *Introdução à Econometria*, Rio de Janeiro: LTC, 3^a. ed.

Mills, T. C. (1994) *The Econometric Modelling of Financial Time Series*, Cambridge: Cambridge University Press.

Stewart, J. (1991) *Econometrics*, New York: Philip Allan.