

Componente Curricular: Econometria II		
Período: 6º	Tipo: Obrigatório	Código: 04191
Carga Horária Total: 60 h	Número de Créditos: 04	
Pré-Requisitos: Econometria I	Co-Requisitos: Nenhum	
Ementa		
Conceitos básicos da pesquisa quantitativa. Estimação, teste e previsão de modelos da microeconomia e macroeconomia usando dados da economia brasileira e dados internacionais. Função de demanda, função de oferta, função de produção, função de custos etc. Função consumo, a lei de Okun, a curva de Phillips, Demanda por moeda, etc. Estimar um modelo simples de demanda agregada e oferta agregada para o Brasil. Análise de séries temporais, especialmente métodos para o ajuste sazonal.		
Conteúdo Programático		
Séries Temporais Determinísticas		
1. Modelos de ajustamento e extrapolação simples		
2. Método das Médias Móveis		
3. Decomposição da Série Determinística e Previsão		
4. Suavização Linear Exponencial		
Séries Temporais Lineares Estocásticas		
1. Processos Estocásticos e Séries Estacionárias		
2. Modelos Autoregressivos e Médias Móveis		
3. Modelos Integrados Autoregressivos e Médias Móveis		
Estimativas e Verificações dos Modelos ARIMA		
1. Estimativas		
2. Verificações e diagnósticos		
Previsão de Modelos de Séries Temporais ARIMA - Aplicações da previsão		
Tópicos Especiais		
1. Cointegração		
2. Causalidade		
Referências		
Básicas:		
BUENO, R. L. S.. Econometria de Séries Temporais. São Paulo: Cengage Learning, 2008		
STOCK J. e WATSON M.. Econometria. São Paulo: Addison Wesley, 2004		
WOOLDRIDGE, Jeffrey M. Introdução à econometria: uma abordagem moderna . São Paulo: Cengage Learning, 2011. xxiii, 701 p.		
Complementares:		
BISGAARD, S. e KULAHCI, M.. Time Series Analysis and Forecasting by Example New York: Wiley & Sons, Inc., 2011.		
BOX, G. E., JENKINS G. M., REINSEL, G. C.. Time Series Analysis: Foerecasting and Control. New Jersey: Prentice-Hall, Inc., 1994		
HAMILTON, J. D.. Time Series Analysis. Princeton: Princeton University Press, 1994.		
MADDALA, G.S. Introdução à econometria , Rio de Janeiro: LTC, 2003		
MORETTIN, P. A.. Econometria Financeira , Editora Blucher, 2ª Ed., 2011		