

UNIVERSIDADE FEDERAL DO PARANÁ
Programa de Pós-graduação em Desenvolvimento Econômico (PPGDE)
EMENTA DE MACROECONOMETRIA DECO7028

Código da disciplina: DECO7028

Carga horária: 60 horas

Professor responsável: Marcos Minoru Hasegawa

Pré-requisito: Econometria

Objetivo: entregar a teoria e a aplicação das ferramentas básicas necessárias na análise econométrica de séries temporais e na estimação de modelos macroeconômicos.

Ementa: equações em diferenças, estacionariedade, processos de médias móveis, processos autoregressivos, processos autorregressivos de média móvel, processos estacionários, processos não estacionários, modelos autoregressivo vetorial, modelos de cointegração, modelos de heterocedasticidade condicional.

Bibliografia:

Box, G. E. P.; Jenkins, G. M.; Reinsel, G. C.; Ljung, G. M. **Time Series Analysis**. Fifth Edition. New Jersey: Wiley, 2016. 669p.

Bueno, R. L. S. **Econometria de Séries Temporais**. 2ª edição. São Paulo: Editora Cengage, 2011. 341p.

Chiang, A. C.; Wainwright, K. **Matemática para Economistas**. 4ª edição. Rio de Janeiro: Elsevier/Campus, 2006. 659p.

Cowpertwait, P. S. P.; Metcalfe, A. W. **Introductory Time Series with R**. Springer, 2009. 254p.

Enders, E. **Applied Econometrics Time Series**. 2nd edition. Wiley, 2004. 460p. (Wiley Series in Probability and Statistics)

Favero, C.A. **Applied Macroeconometrics**. Oxford University Press, 2001. 296p.

Greene, W. H. **Econometric Analysis**. 7th Edition. Essex: Prentice-Hall, 2012. 1238p.

Hamilton, J. D. **Time Series Analysis**. 1st edition. Princeton University Press, 1994. 820p.

Hayashi, F. **Econometrics**. 1st edition. Princeton: Princeton University Press, 2000. 683p.

Matloff, N. **The art of R programming: a tour of statistical software design**. San Francisco: No Starch Press, 2011. 373p.

Morettin, P. A.; Tolo, C. M. C. **Análise de Séries Temporais**. 2ª edição. São Paulo: Editora Edgard Blucher, 2006. 538p.

Morettin, P. A. **Econometria Financeira: um curso em séries temporais financeiras**. 2ª edição. Editora Blucher, 2011. 336p.

Patterson, K. **An Introduction to Applied Econometrics: a time series approach**. London: Palgrave MacMillan, 2000. 795p.

Pfaff, B. **Analysis of Integrated and Cointegrated Time Series with R**. Springer, 2006. 139p.