|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| PROGRAMA DA DISCIPLINA | | |
| CÓDIGO | | DISCIPLINA: |
| ECO100189 | | **Econometria III** |
| CH | Créditos | Professor(a) |
| 60 | 4 | Marcelo Inácio Ferreira Ferraz e Carlos Eduardo Iwai Drumond |
| Ementa | | Econometria de Séries Temporais: processos estocásticos, estacionariedade estrita e de segunda ordem, e ergodicidade. Modelo de Box & Jenkins. Modelos lineares estacionários para a média condicional (ARMA e VARMA). Introdução às séries temporais no domínio da frequência. Tendências, séries não estacionárias testes de raízes unitárias. Cointegração. Modelos para a variância condicional (família GARCH e volatilidade estocástica). Modelos em espaço de estados. Modelos VAR estruturais (SVAR), identificação e funções impulso-resposta. Uso dos softwares R e EViews. |

|  |
| --- |
| **Bibliografia:**  WOOLDRIDGE, Jeffrey M. Introdução à econometria: uma abordagem moderna. São Paulo: Thomson, 2012. 684p.  MORETTIN, P.A ; TOLOI, C.M. Análise de Séries Temporais. São Paulo: Edgard Blücher, 2006, 564p.  Bibliografia Complementar  ENDERS, W. Applied Econometric Time Series. New York: Wiley, 2004, 460p. HANILTON, J. D. Time series analysis. New Jersey: Princton, 1994, 799p.  MADDALA, G.S. Introdução à econometria. 3 ed. Rio de Janeiro: LTC, 2003, 345p.  MORETTIN, P.A. Econometria financeira: um curso em séries temporais financeiras. São Paulo: Edgar Blucher, 2017, 420p.  HEISS, F. Using R for introductor econometrics. Dusseldorf: Createspace Independent Publishing Platform, 2016, 356p.  GROLEMUND, G., WICKMAM, H. R para Data Science: Importe, arrume, transforme, visualize e modele dados. Rio de Janeiro: Alta Books, 2019, 528p  BENTO, José Alex do Nascimento. Ensaios sobre economia ambiental na América Latina. 2022. BILAS,R. A. Teoria microeconômica. Rio de Janeiro: Ed. Forense Universitária, 12ª ed., 404 p., 1993.  BUARQUE, C. Avaliação econômica de projetos: uma aplicação didática. Rio de Janeiro: Campus, 1991. 266 p.  DALY, H. E.; FARLEY, J. Ecological Economics: principles and applications. 2 ed. Washington, DC: Island Press, 2010. de Janeiro: Campus, 2003.  DOS ANJOS XAVIER, Jordana et al. IMPACTOS DAS MUDANÇAS CLIMÁTICAS NAS  FLORESTAS TROPICAIS. Revista Gestão & Sustentabilidade Ambiental, v. 11, n. 2, p. 65-82, 2022.  HILL, R. C.; GRIFFITHS, E. W.; JUDGE, G. G. Econometria. São Paulo: Saraiva, 1999, 410 P.  LADEIRA, H. P. Quatro décadas de Engenharia Florestal no Brasil. Viçosa: Sociedade de investigações florestais, 2002, 207 p.  MAGALHÃES, G. F. P. Teorias da demanda e do comportamento do consumidor. Viçosa: UFV, 2005, 328 p.  MAY, P.& LUSTOSA, M.C. & VINHA, V. Economia do Meio Ambiente. Rio Meio Ambiente. Campinas: Unicamp, 1997.  PASSOS, C. R. M.; NOGAMI, O. Princípios de economia. 5. ed. rev. São Paulo: Pioneira |