

Syllabus

[cmcd.economia@fgv.br]

Course: Econometrics III (Time Series Econometrics)

Professor: Pedro Valls

2016 SECOND SEMESTER

COURSE OUTLINE

The course provides an introduction to time series methods in econometrics covering stationary series, aspect of trend behaviour, detrending mechanisms and their properties, unit roots theory, cointegration system approach. Mainly time-domain methods are discussed but an introduction to frequency-domain is presented.

PROGRAM

1. Stochastic Process
2. ARMA Models
3. Integrated Process
4. Unit Roots
5. Kalman Filter
6. Autoregressive Distributed Lag Model
7. VAR and VEC

BIBLIOGRAPHY

1. Valls, P. (2014) Econometrics Lecture Notes
2. Hamilton (1994) Time Series Analysis. Princeton University Press.
3. Harvey, A.C. (1993) Time Series Models. MIT Press.
4. Johnston, J & DiNardo, J. (1997) Econometrics Methods. 4th Edition. Mac Graw Hill
5. Lutkepohl, H. (2005) "A New Introduction to Multiple Time Series Analysis". Springer Verlag.

GRADING

Applied Econometric Paper; 50%

Final Exam: 50%

[OBS: Art. 46º - Aos alunos dos Cursos de Mestrado Acadêmico e Doutorado é atribuída nota em cada disciplina, variável de 0 (zero) a 10 (dez).

I - A nota final dos alunos em cada disciplina, variável de 0 (zero) a 10 (dez), é a média ponderada das notas atribuídas:

I.I) a uma ou mais formas de avaliações intermediárias;

I.II) à avaliação final, que pode constar de prova escrita ou de trabalho final;

II - O peso atribuído à nota de cada uma das formas de avaliação da disciplina é determinado pelo professor da disciplina e deve constar explicitamente do respectivo programa, não sendo permitido atribuir peso superior a 60% (sessenta por cento) a nenhuma das formas de avaliação especificadas.]

PROFESSOR – EMAILS: PEDRO.VALLS@FGV.BR