

Syllabus

[cmcd.economia@fgv.br]

Course: Special Topics in Time Series Econometrics
Professor: Pedro Valls

2016 SECOND SEMESTER

COURSE OUTLINE

The course provides additional topics in time series methods in econometrics covering frequency-domain methods, structural VAR and VEC, Factor Models, Non Linear Models and Forecasting

PROGRAM

1. Frequency Domain
2. SVAR and SVEC
3. Factor Models
4. GMM in Time Series
5. Regime Switching Models
6. Forecasting with many predictor

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. Lutkepohl, H. (2005) "A New Introduction to Multiple Time Series Analysis". Springer Verlag.
5. Bernanke, B.S., J. Boivin and P. Elias (2005). "Measuring the effects of monetary policy: a factor-augmented vector autoregressive (FAVAR) approach", *Quarterly Journal of Economics* 120: 387–422.
6. Stock, J.H., and M.W. Watson (2006) "Forecasting with Many Predictors," ch. 6 in *Handbook of Economic Forecasting*, ed. by Graham Elliott, Clive W.J. Granger, and Allan Timmermann, Elsevier, 515-554.
7. Elliot, G. and Timmermann, A. (2016) "Economic Forecasting". Princeton University Press.
8. Hendry, D.F. and Doornik, J.A. (2014) "Empirical Model Discovery and Theory Evaluation: Automatic Selection Methods in Econometrics", The MIT Press.

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