

Conteúdo Programático

Eviews - Série Temporal

Conteúdo:

- Revisão da lógica básica de funcionamento do Econometric Views – E-views
- Diferenças fundamentais entre trabalhar com modelos tradicionais de econometria e modelos de séries temporais – o problema das relações espúrias
- Dessazonalização de séries temporais – funções do E-views
- Estacionariedade: análise gráfica, correlograma e testes de raiz unitária
- Modelo univariado de séries de tempo – ARIMA (box & Jenkins) – previsão
- Teste de causalidade granger
- Modelo regressão da causa e efeito para variáveis não estacionárias – testes de cointegração – previsão
- Modelo de correção de erros – previsão
- Vetor auto-regressivo (VAR) – vetor de correção de erros (VEC) – previsão
- Modelo resposta ao impulso – análise gráfica
- Estimação de modelos de séries temporais com variância constante. ARCH e GARCH