

Séries Temporais (STEM-EAP17)
Mestrado em Econometria Aplicada e Previsão
1.º Semestre 2018/2019
 Sala 007-F1

- Docente: **Nuno Crato**, 105 Quelhas 4, 21 392 5846 (ext. 3846) ncrato@iseg.ulisboa.pt
- Bibliografia: **[W]** W.S. Wei, *Time Series Analysis: Univariate and Multivariate Methods*, 2nd Edition, Addison-Wesley, 2005 (Bibliografia principal e suficiente)
[E] W. Enders, *Applied econometric Time Series: An Introduction*, 4th Edition, Wiley, 2014
[BD] P.J. Brockwell e R. Davis, *Time Series: Theory and Methods*, 2nd ed. Springer, 1997
- Software: PEST/ITSM, EViews ou outro
- Objectivo: Esta cadeira inicia o estudo dos métodos de análise e previsão de séries temporais. Desenvolve os modelos lineares, a análise de autocorrelação e rudimentos de análise espectral. Fornece uma oportunidade para os estudantes se treinarem na análise e previsão de séries económicas e financeiras.
- Avaliação: Inclui exercícios individuais, trabalho de grupo e exame final (percentagens indicativas: 20%, 40% e 40%).

Programa

Aulas	Tópicos	Livro [W]
18 Set	Processos estacionários, ACF, PACF, MA(∞) e AR(∞)	2.1 – 6
25 Set	Processos autoregressivos e de médias móveis	3.1 – 3
02 Out	Processos ARMA	3.4
09 Out	Processos não estacionários	4.1 – 3
16 Out	Previsão	5.1 – 7
23 Out	Identificação	6.1 – 2
	Sazonalidade	8.1 – 3
30 Out	Estimação e seleção de modelos	7.1 – 7, 8.4
06 Nov	Preparação de trabalhos de grupo	
13 Nov	Testes de raízes unitárias	9.1 – 4
20 Nov	Números complexos, análise de Fourier	11.1 – 5
27 Nov	O espectro e o periodograma	12.1 – 13.2
04 Dez	Estimação do espectro	13.3
11 Dez	Apresentação e discussão de trabalhos de grupo	