

Séries Temporais (STEM-EAP17)
Mestrado em Econometria Aplicada e Previsão
1.º Semestre 2019/2020
 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 modelos lineares, análise de autocorrelação e rudimentos de análise espectral. Fornece uma oportunidade de treino prático na análise e previsão de séries económicas e financeiras.
- Avaliação: Dois testes, trabalho de grupo e exame final (2x15%, 35% e 35%).

Aulas	Tópicos	Livro [W]
18 Set	Séries temporais e processos estacionários,	2.1 – 4
25 Set	ACF, PACF, MA(∞) e AR(∞)	2.5 – 6
02 Out	Processos autoregressivos e de médias móveis	3.1 – 3
09 Out	Processos ARMA	3.4
16 Out	Processos não estacionários – TESTE 1	4.1 – 3
23 Out	Previsão	5.1 – 7
30 Out	Identificação e sazonalidade	6.1 – 2, 8.1 – 3
06 Nov	Estimação e seleção de modelos	7.1 – 7, 8.4
13 Nov	Preparação de trabalhos de grupo – TESTE 2	
20 Nov	Testes de raízes unitárias	9.1 – 4
27 Nov	Análise de Fourier, o espectro e o periodograma	11.1 – 2, 12.1 – 3
04 Dez	Periodograma, estimação do espectro	13.1-13.3
11 Dez	Apresentação e discussão de trabalhos de grupo	