

Programa de Aperfeiçoamento para Carreiras – 2018

Curso: Macroeconometria

Professor: Fausto José Araújo Vieira

Período: 17, 20, 24 e 27 de abril e 04, 08, 11, 15, 18 e 22 de maio de 2018.

Horário: 8h30 às 12h30

Carga Horária: 40 horas.

Objetivo

Ao final do curso, o aluno será capaz de estimar modelos de séries de tempo e projetar séries econômicas usando o software “R”.

Ementa

Modelagem de processos estacionários (Box-Jenkins). Raiz unitária. Modelos VAR e VEC. Análise de cointegração. Sistema de equações simultâneas. Modelos SUR. Causalidade de Granger. Análise de componentes principais. Modelos de projeção do para a inflação (VAR). Estimativa de modelos estruturais de pequeno porte. Modelo FAVAR para projeção do PIB.

Metodologia de Ensino

As aulas ministradas serão aplicações de casos reais. Após apresentar o caso da economia brasileira ou internacional, discutiremos como a teoria de modelagem econômica e de séries temporais podem solucionar o problema levantado.

O foco das aulas é dar noção dos fundamentos teóricos, mas principalmente, na aplicação para os casos concretos, possibilitando o aluno a estimativa e projeção dos indicadores. Serão realizados diversos exercícios em sala de aula.

Avaliação

A avaliação será realizada por exercícios práticos durante o período da aula.

PLANO DE AULA

17 de abril – terça-feira

<i>8h30 às 10h30</i>	Conceitos básicos de Econometria e Comandos no R-Studio
<i>10h30 às 10h45</i>	Intervalo
<i>10h45 às 12h30</i>	Relaxando as hipóteses básicas e séries temporais

20 de abril – sexta-feira

<i>8h30 às 10h30</i>	Processo Estacionário – Modelo ARMA
<i>10h30 às 10h45</i>	Intervalo
<i>10h45 às 12h30</i>	Processo Estacionário – Modelo ARMA

24 de abril – terça-feira

<i>8h30 às 10h30</i>	Processo Estacionário – Modelo ARMA
<i>10h30 às 10h45</i>	Intervalo
<i>10h45 às 12h30</i>	Processo Estacionário – Modelo ARMA (Sazonalidade)

27 de abril – sexta-feira

<i>8h30 às 10h30</i>	Processo Não Estacionário – Raiz Unitária
<i>10h30 às 10h45</i>	Intervalo
<i>10h45 às 12h30</i>	Processo Não Estacionário – Raiz Unitária

04 de maio – sexta-feira

<i>8h30 às 10h30</i>	Modelos Econométricos Dinâmicos
<i>10h30 às 10h45</i>	Intervalo
<i>10h45 às 12h30</i>	Sistema de equações simultâneas

08 de maio – terça-feira

<i>8h30 às 10h30</i>	Vetor Autorregressivo (VAR)
<i>10h30 às 10h45</i>	Intervalo
<i>10h45 às 12h30</i>	Vetor Autorregressivo (VAR)

11 de maio – sexta-feira

<i>8h30 às 10h30</i>	Vetor Autorregressivo Estrutural
<i>10h30 às 10h45</i>	Intervalo
<i>10h45 às 12h30</i>	Vetor Autorregressivo Estrutural

15 de maio – terça-feira

<i>8h30 às 10h30</i>	Componentes Principais
<i>10h30 às 10h45</i>	Intervalo
<i>10h45 às 12h30</i>	Estimação do modelo FAVAR

18 de maio – sexta-feira

8h30 às 10h30	Vetor de Correção de Erros (VECM)
10h30 às 10h45	Intervalo
10h45 às 12h30	Vetor de Correção de Erros (VECM)

22 de maio – terça-feira

8h30 às 10h30	Vetor de Correção de Erros (VECM)
10h30 às 10h45	Intervalo
10h45 às 12h30	Vetor de Correção de Erros (VECM)

Bibliografia Básica:

Bueno, Rodrigo L. S. Econometria de séries temporais. São Paulo: Cengage Learning, 2015.
Shumway, Robert e Stoffer, David. Time Series Analysis and Its Applications with R Examples.
New York: Springer, 2011.

Bibliografia Complementar:

Hamilton, James. Time Series Analysis. Princenton University Press, 1994.
Gujarati, Damodar N. Econometria Básica. Makron Books Ltda, 2000.
Trabalhos para discussão – BCB. <http://www.bcb.gov.br/pec/wps/port/default.asp>
Trabalhos aceitos nos congressos da ANPEC. <http://www.anpec.org.br/novosite/br/encontros>
NBER working papers - <http://www.nber.org/papers>

Professor



Fausto José Araújo Vieira

Mestrado e doutorado pela Escola de Economia de São Paulo da Fundação Getúlio Vargas (EESP-FGV). Atualmente é Coordenador-Geral de Política Macroeconômica da Secretaria de Planejamento e Assuntos Econômicos – SEPLAN/MP. Tem experiência na área de econômica de algumas instituições financeiras, com foco na análise de indicadores macroeconômicos e estimação/projeção dessas séries.