

PÓS-GRADUAÇÃO – Ementa de disciplina  
Mestrado e Doutorado em Economia

DISCIPLINA: Econometria do Risco  SIGLA: ECOR	CÓDIGO: MDPEEC029
PROFESSOR: Renato Galvão Flores Jr.	CARGA HORÁRIA: 40h  CRÉDITOS: 4
OBRIGATÓRIA: <input type="checkbox"/> SIM <input checked="" type="checkbox"/> NÃO	CURSO: <input type="checkbox"/> M <input type="checkbox"/> D <input checked="" type="checkbox"/> MD
PRÉ-REQUISITO: É essencial ter concluído o curso de Econometria I e Teoria Microeconômica I e II.	
ÁREA DE CONCENTRAÇÃO: ESTATÍSTICA E ECONOMETRIA	
<p><b>EMENTA</b></p> <p><b>Curso de Econometria do Risco</b></p> <p>Risco: conceitos básicos e formas de medição. Revisão das densidades assimétricas e de caudas pesadas; valores extremos e suas estatísticas. Porque grande parte dos estudos econométricos aplicados está errada. A falácia da previsão e a falência dos principais métodos; a ilusão do VaR; downsize risk e aplicações. Fragilidade, robustez e anti-fragilidade. Convexidade e previsão; desigualdades generalizadas de Jensen e sua aplicação. As três grandes fontes de erro devidas a ignorar a convexidade/concavidade. Métodos para aumentar a anti-fragilidade de sistemas. A avaliação dos sistemas de rating com relação ao risco. Mecanismos de alerta em sistemas complexos de risco; aplicações à logística. Aplicações a finanças, à economia internacional e a catástrofes naturais.</p> <p>Avaliação: A avaliação constará de dois trabalhos práticos, em princípio realizados individualmente e, se for achado necessário, uma prova teórica ao final do curso.</p>	
<p><b>OBJETIVOS</b></p> <p>Esse curso pioneiro pretende dar uma visão geral da questão do risco, particularmente em seus aspectos econométricos, com aplicações a sistemas vários de controle de risco em finanças, operações logísticas complexas, seguros e catástrofes naturais.</p>	
<p><b>BIBLIOGRAFIA</b></p> <p>As referências constarão sobretudo de artigos em revistas especializadas –de áreas diversas, não só economia- que serão indicados ao longo do curso. Para os trabalhos práticos é possível que seja também necessária a leitura de algum Manual ligado a um sistema específico de controle de risco.</p>	