

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

DISCIPLINA: MACROECONOMIA COMPUTÁVEL SIGLA: MC	CÓDIGO: MDPTEC103
PROFESSOR: RAFAEL CHAVES SANTOS	CARGA HORÁRIA: 40H  CRÉDITOS: 4
DATA DE INÍCIO: 03/04/2018  DATA DE FIM: 27/06/2018	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: MICROECONOMIA 1 e ESTATÍSTICA	
ÁREA DE CONCENTRAÇÃO: MACROECONOMIA	
<p>EMENTA</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Modelos DSGE: declaração, validação e estimação (MatLab/Dynare)</li> <li>• Modelos de expectativas racionais com crises por falha de coordenação (MatLab)</li> <li>• Modelos de projeções econométricas que minimizam MSE por horizonte (Eviews)</li> <li>• Introdução a modelos não parametrizados – “Random-Forest” (R)</li> </ul>	
<p>OBJETIVOS</p> <p>Exposição de métodos/modelos que permitem (i) relacionar resultados macroeconômicos observados com os esperados pela teoria econômica (ii) determinar regularidades empíricas observadas de modo a obter conteúdo preditivo (iii) discussão normativa de políticas ótimas, em especial a política monetária e fiscal.</p>	
<p>BIBLIOGRAFIA</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>a) “Samba: Stochastic Analytical Model with Bayesian Approach”, Castro, Gouvea, Minella, Santos, Souza-Sobrinho, WPS Banco Central do Brasil nº 239, Abril, 2011.</li> <li>b) “Efeitos da Globalização na Inflação Brasileira”, Santos e Leon, WPS Banco Central do Brasil nº 201, janeiro de 2010.</li> <li>c) “Crises and Prices: Information Aggregation, Multiplicity and Volatility”; Angeletos and Werning, American Economic Review 2006, Volume 96, Issue 5, Pages 1720-1736</li> <li>d) “Inflation Targeting with Imperfect Information”; Araujo, Berriel and Santos, International Economic Review 2016, Volume 57, Issue 1, pp Pages 255-270</li> <li>e) “Self-Fulfilling Debt Crises”; Cole and Kehoe, The Review of Economic Studies 2000, Volume 67, Issue 1 Pages 91-116</li> <li>f) “Welfare analysis of currency regimes with defaultable debts”, Araujo, Leon and Santos, Journal of International Economics 2013, Volume 89, Issue 1, Pages 143-153</li> <li>g) “Bargained haircuts and debt policy implications”, Araujo, Leon and Santos, Economic Theory, December 2017, Volume 64, Issue 4, Pages 635–656</li> </ol>	