

Proposta de Disciplina Aplicada

Proposta de Disciplina Aplicada

sugestão

Proposta de Disciplina Aplicada

sugestão

Previsões Financeiras e Econômicas Computáveis

Por que estamos aqui?

Por que estamos aqui?

Reação ao abaixo assinado pela volta do curso “Sinais Antecedentes de Ciclos de Negócios”. A reação dos alunos é um ingrediente para obtenção de maior qualidade neste Mestrado.

Por que estamos aqui?

Reação ao abaixo assinado pela volta do curso “Sinais Antecedentes de Ciclos de Negócios”. A reação dos alunos é um ingrediente para obtenção de maior qualidade neste Mestrado.

"Rules Rather than Discretion: : The inconsistency of optimal planning" Prescott and Kydland argue that purpose and goals of economic planning and policy is to trigger a desired response from the economy. However, Prescott and Kydland realized that ...

Por que estamos aqui?

Reação ao abaixo assinado pela volta do curso “Sinais Antecedentes de Ciclos de Negócios”. A reação dos alunos é um ingrediente para obtenção de maior qualidade neste Mestrado.

O abaixo assinado coincidiu com uma proposta de curso enviado à coordenação com base na minha experiência de orientação e (co)orientação de dissertações/teses.

Discussão de ementa

Objetivo do curso?

Por que estamos aqui?

- Aluno ou Cliente?

Por que estamos aqui?

- Aluno ou Cliente?
- Fase inicial (Cliente) – etapa de discussão de literatura/teorias, disciplinas expositivas, proposta de problemas aplicados.
 - Aluno com expectativa de ser apresentado às perguntas e às respostas relevantes do ponto de vista científico e aplicado.
 - Entendimento de que a responsabilidade é 100% do professor.
 - Sentimento de certeza e por vezes de indignação/acompanhado de frustração.

Por que estamos aqui?

- Aluno ou Cliente?
- Fase final (Aluno) – etapa da dissertação: incerteza.
 - Sentimento de incapacidade.
 - Entendimento de que a responsabilidade é 100% do aluno.

Por que estamos aqui?

- Esse curso pretende auxiliar o aluno na fase final do curso, prover ferramentas para a elaboração de dissertação.

Curso proposto

- “O objetivo do curso é prover o passo a passo (“hands on” - em laboratório) de como realizar projeções de variáveis e verificar a eficiência das projeções.
- Especificar um modelo, projetar, e verificar eficiência.
- Usar um case de literatura (correlação vs antecedentes)
- Softwares: MatLab, Eviews, Excel, e Stata (talvez)

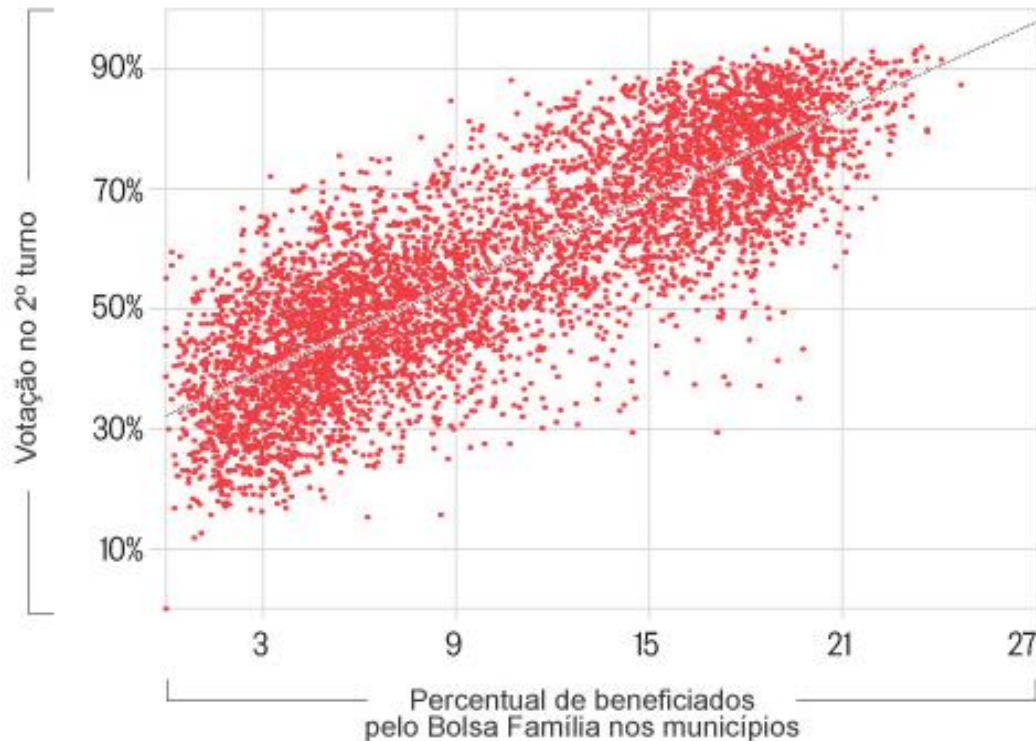
Curso proposto

- Passo a passo: tabulação de séries, tratamento para obtenção de *estacionariedade*, correlação econômica vs. estatística, testes dentro da amostra (poder explanatório, sazonalidade, heterocedasticidade, auto-correlação), variáveis dummies, previsão, erro de previsão, eficiência por janela de previsão.
- Preferencia por defasagens
- Var auxiliar

Curso proposto

- Trato com Big-Data: Stata. Extração de informação de um volume grande de series.

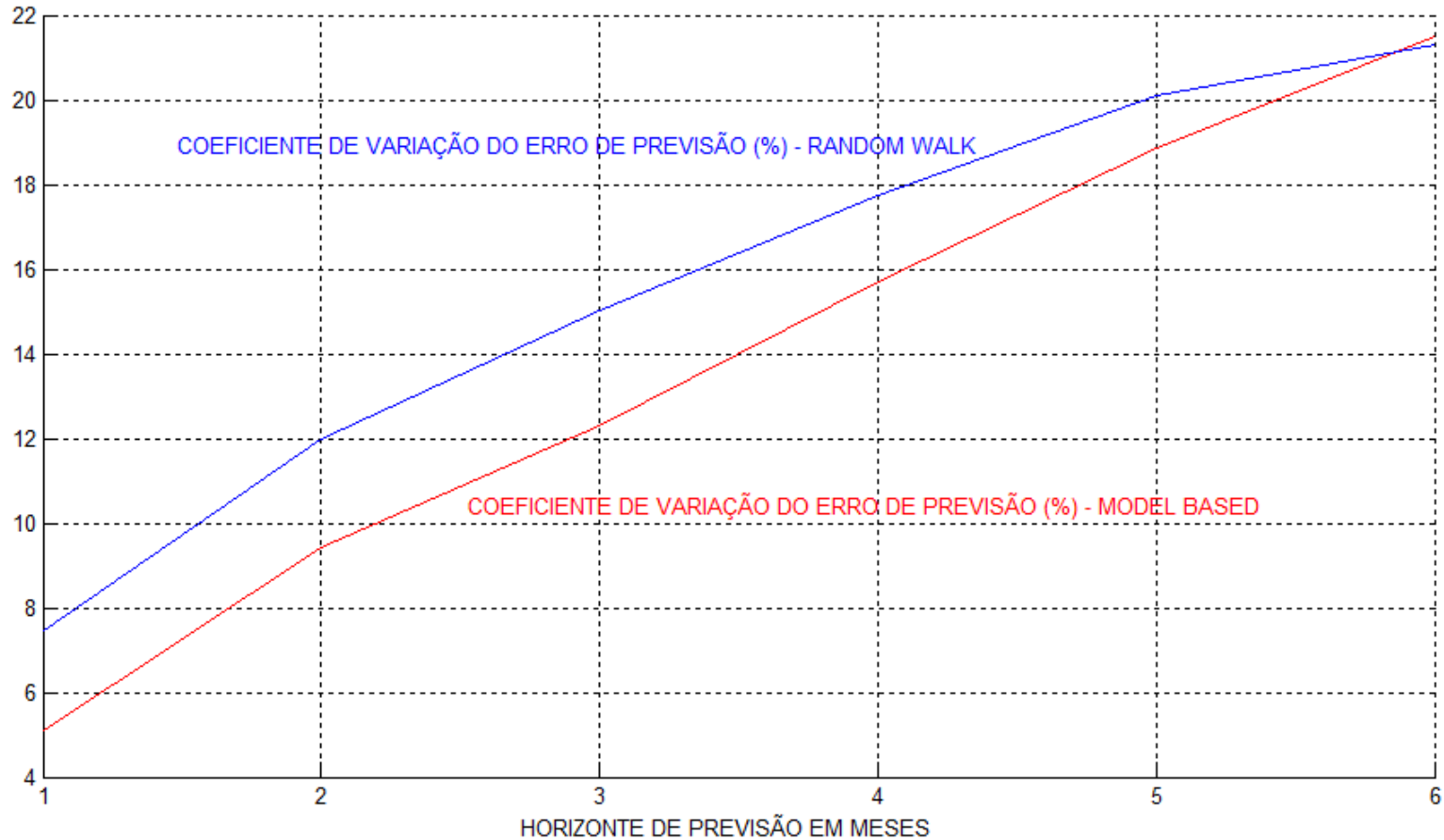
NO 2º TURNO



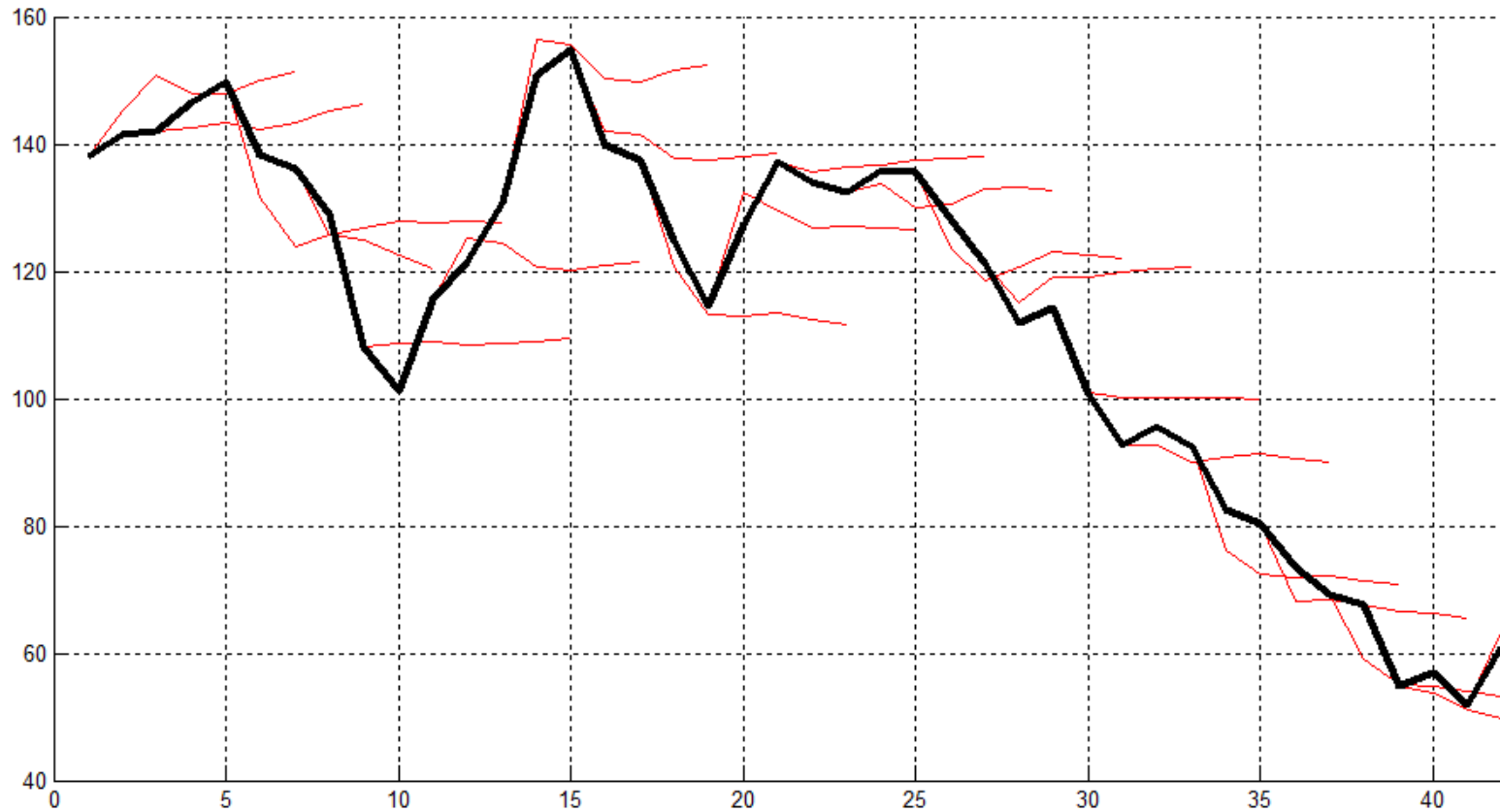
Curso proposto

- Aplicação técnica de discussão econômica e/ou financeira de curto-prazo.
Exemplos:
- Correlação e precificação de *equity* (CAPM)
- Teste da UIP
- Teste de uma curva de Phillips
- Previsão de BRL
- Previsão de CRB

Dissertação Ana Lucas



Dissertação Ana Lucas



Curso proposto

- A totalidade das aulas será de natureza prática, em laboratório (MatLab/Eviews/Stata?),
- não será exigido conhecimento prévio de softwares estatísticos e/ou séries temporais
- Espera-se ao fim do curso: aluno preparado e seguro para produzir um trabalho stictu-sensu com dados.

Curso proposto

5 encontros (15hs) - evitar formato longo

- European Commission (2007), The Joint Harmonised EU Programme of Business and Consumer Survey. User Guide.
- **D. Giannone, L. Reichlin, D. Small (2008), Nowcasting: The real-time informational content of macroeconomic data, Journal of Monetary Economics, 55, 665-676.**
- JH Stock, MW Watson (2011). Dynamic Factor Models. Oxford Handbook of Economic Forecasting.
- M Forni, M Hallin, M Lippi, L Reichlin. The generalized dynamic-factor model: Identification and estimation. Review of Economics and statistics, 2000 - MIT Press.
- C Doz, D Giannone, L Reichlin (2012). A Quasi-Maximum Likelihood Approach for Large, Approximate Dynamic Factor Models. Review of economics and statistics.
- Domenico Giannone, Lucrezia Reichlin and Saverio Simonelli. Nowcasting EURO Area Economic Activity in Real Time: The Role of Confidence Indicators. National Institute Economic Review 2009.
- B. Siliverstovs and K.A. Kholodilin (2010), Assessing the Real-Time Informational Content of Macroeconomic Data Releases for Now-/Forecasting GDP: Evidence for Switzerland, KOF Working Paper No. 251.
- **Avaliando o Poder Preditivo de Curto Prazo dos Índices de Confiança. Relatório de Inflação do Banco Central. Dezembro de 2013.**
- Jacobs, J.P.A.M. and J.-E. Sturm (2008), The information content of KOF indicators on Swiss current account data revisions, Journal of Business Cycle Measurement and Analysis, 4:2, 163-183.
- Jacobs, J.P.A.M. and J.-E. Sturm (2005), "Do ifo indicators help explain revisions in German industrial production?", in: Ifo Survey Data in Business Cycle and Monetary Policy Analysis, editors J.-E. Sturm and T. Wollmershauser, Physica Verlag, 93-114.
- Graff, M. and J.-E. Sturm (2010), "The Information Content of Capacity Utilisation Rates for Output Gap Estimates", KOF Working Paper No. 269.
- E.M. Köberl and S.M. Lein (2011), The NIRCUI and the Phillips curve: an approach based on micro data, Canadian Journal of Economics, 44:2, 673-694.
- Pirmin Fessler, Fabio Rumler e Gerhard Schwarz. A micro-based non inflationary rate of capacity utilisation as a measure of inflationary pressure - evidence for Austria. Mimeo 2012.

- **Sergio Afonso Lago Alves e Arnildo da Silva Correa.** Um conto de três hiatos: **desemprego**, utilização da capacidade instalada da indústria e produto. Trabalho para discussão 339 Banco Central do Brasil.
- S.M. Lein and E.M. Koerber (2009), Capacity Utilisation, Constraints and Price Adjustments under the Microscope, KOF Working Paper No. 239.
- C. Müller and E. Koerber (2008), Business Cycle Measurement with Semantic Filtering: A Micro Data Approach, KOF Working Paper No. 212. 4. Sondagem dos Consumidores
- Soren T. Anderson, Ryan Kellogg, James M. Sallee, and Richard T. Curtin. Forecast- ing Gasoline Prices Using Consumer Surveys. American Economic Review: Papers & Proceedings 2011, 101:3, 110?114
- Richard T. Curtin. Survey of Consumers. Survey Research Center - University of Michigan.
- Ting Yan and Richard Curtin. The Relation Between Unit Nonresponse and Item Nonresponse: A Response Continuum Perspective. International Journal of Public Opinion Research Vol. 22 No. 4.
- Olivier Armantier et al. Inflation Expectations and Behavior: Do survey respondents act on their beliefs?
- Olivier Armantier et al. The Price is Right: Updating of Inflation Expectations in a Randomized Price Information Experiment. Federal Reserve Bank of New York staff reports 543.
- Wandu Bruine de Bruin et al. Measuring Consumer Uncertainty about Future Inflation. Federal Reserve Bank of New York staff reports 415.
- Wandu Bruine de Bruin et al. Expectations of Inflation: The Biasing Effect of Thoughts about Specific Prices. Federal Reserve Bank of New York staff reports 489.
- Wandu Bruine de Bruin et al. Expectations of Inflation: The Role of Demographic Variables, Expectation Formation, and Financial Literacy. The Journal of Consumer Affairs, Vol. 44, No. 2, 2010.
- Wandu Bruine de Bruin et al. Rethinking the Measurement of Household Inflation Expectations: Preliminary Findings. Federal Reserve Bank of New York staff reports 359.
- **Wandu Bruine de Bruin et al. Improving Survey Measures of Household Inflation Expectations.**
- Domenico Giannone, Lucrezia Reichlin and Saverio Simonelli. Do Survey Forecast Industrial Production? mimeo.