

PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA - UFSC

Professor: Guilherme Moura

Identificação da Disciplina:

Nome: Econometria Bayesiana

Carga Horária: 60 h

Ementa: Apresentação de conceitos fundamentais da teoria Bayesiana e como eles afetam a análise do modelo de regressão linear. Após introdução dos conceitos básicos, atenção será dada a métodos Bayesianos usados em pesquisas macroeconômicas e na área de finanças.

Pré-Requisitos: Econometria I. Conhecimento prévio de séries de tempo e de linguagem de programação matricial são desejáveis, mas não obrigatórios.

Objetivo: O objetivo deste curso é a apresentar a econometria Bayesiana e seu uso em economia e finanças.

Programa:

- Revisão de probabilidade.
- Introdução à econometria Bayesiana.
- Inferência Bayesiana no modelo normal clássico de regressão linear.
- Modelo VAR Bayesiano.
- Modelagem Bayesiana para modelos de estado-espço.

Bibliografia Obrigatória:

- CASELLA, G.; BERGER, R. L. Inferência Estatística. São Paulo: Cengage Learning, 2014.
- KOOP, G. Bayesian Econometrics. Sussex: Willey, 2003.
- KOOP, G.; KOROBILIS, D. Bayesian Multivariate Time Series Methods for Empirical Macroeconomics. In: Foundations and Trends in Econometrics, Vol. 3, No. 4, 2009.

Bibliografia Complementar:

BAUWENS, L.; LUBRANO, M.; RICHARD, J. F. Bayesian Inference in Dynamic Econometric Models. Oxford: OUP, 2003.

DEL NEGRO, M.; SCHORFHEIDE, F. Bayesian Macroeconometrics. The Oxford Handbook of Bayesian Econometrics. 2011.

GREENBERG, E. Introduction to Bayesian Econometrics. New York: CUP, 2008.

KIM, C. J.; NELSON, C. E. State-Space Models with Regime Switching. MIT Press, 1999.

MITTELHAMMER, R. Mathematical Statistics for economics and Business. Springer, 2013.

WEST, M.; HARRISON, J. Bayesian Forecasting and Dynamic Models. Springer, 1999.