

**UNIVERSIDADE FEDERAL DE SANTA CATARINA
CENTRO SOCIOECONÔMICO
PROGRAMA DE PÓS-GRADUAÇÃO EM ECONOMIA**

DISCIPLINA: ECONOMETRIA BAYESIANA

CÓDIGO: CNM 4118

CARGA HORÁRIA: 60h - CRÉDITOS: 04

OBJETIVO

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.

EMENTA

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

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

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.

