

UNIVERSIDADE DO ESTADO DO RIO DE JANEIRO - UERJ
Faculdade de Ciências Econômicas - FCE
Programa de Pós-Graduação em Ciências Econômicas - PPGCE

Rio, 1o. semestre de 2021

Prof. Elcyon Caiado Rocha Lima

MACROECONOMETRIA

EMENTA

- I. A representação canônica de modelos de DSGE: a representação Log-linear e a representação Não-linear;
- II. Linearização: Aproximação por série de Taylor e Aproximação Log-Linear;
- III. Métodos de solução de equações de diferenças estocásticas dinâmicas: o método de Sims, o método de Blanchard e Kahn, o método de Klein.
- IV. Técnicas de solução não-lineares: os métodos de projeções, técnicas interativas (programação dinâmica) e técnicas de perturbação.
- V. Preparação dos dados: remoção da tendência e isolamento de ciclos no domínio da frequência.
- VI. Estimação de modelos em Espaço-de-Estados: modelos VAR, VARMA, modelos com Fatores Dinâmicos, modelos com Volatilidade Estocásticas, modelos com Mudança Markoviana de Regime.
- VII. Métodos de Monte Carlo: o amostrador de Gibbs e o algoritmo de Metropolis-Hastings.
- VIII. Estimação através de métodos Bayesianos de modelos estruturais: VAR, FAVAR, Fatores Dinâmicos.
- IX. Estimação de modelos VAR painel;
- X. Calibração de modelos
- XI. Estimação de modelos DSGE: estimação com matching das funções impulso-resposta.

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

Canova, Fabio (2007), *Methods for Applied Macroeconomic Research*, Princeton University Press.

Canova, F. and M. Ciccarelli, (2009). Estimating Multi-country VARs, *International Economic Review*, 50, 929-961.

David N. DeJong, David N. e Chetan Dave (2011), *Structural Macroeconometrics*, Princeton University Press, 2a. edição.

Fernandez Villaverde, J., Rubio Ramirez, J, Sargent , T.and M. Watson, (2007). The A,B,C and D for understanding VARs, *American Economic Review*, 97, 1021-1026

Fernandez Villaverde, J., (2009). The econometrics of DSGE models, NBER working paper 14677.

Kascha, C. and K. Martens (2009). Business cycle analysis and VARMA models, *Journal of Economic Dynamics and Control*, 33, 267-282.

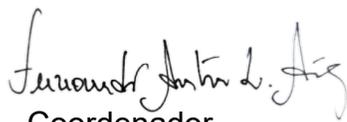
Koop, G., Poirier, D., & Tobias, J. (2020). *Bayesian Econometric Methods*. Cambridge: Cambridge University Press. 2nd Edition

Marimon, Ramon e Andrew Scott (1999) *Computational Methods for the Study of Dynamic Economies*, Oxford Univesity Press.

Ravenna, F., (2007). Vector autoregressions and reduced Form Representations of DSGE models, *Journal of Monetary Economics*, 54, 2048-2064.

Sims, Christopher A, (2002) *Solving Linear Rational Expectations Models*. Computational Economics.

Sims, E., (2012). News, Non-Invertibility and Structural VARs, Notre Dame University, manuscript.



Coordenador

09/12/2020 Mat 38.945-2