UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA	PROGRAMA ANALÍTICO DE DISCIPLINA	Nº FOLHA: RUBRICA:

IDENTIFICAÇÃO				
DISCIPLINA: Teoria Macroeconômica III				CÓDIGO: ERU 706
DEPARTAMENTO: Economia Rural				SIGLA DA UNIDADE: CCA
DURAÇÃO EM SEMANAS	CARGA HORÁRIA SEMANAL			CARGA HORÁRIA TOTAL
15	TEÓRICAS: 4	PRÁTICAS: 0	TOTAL: 4	60

NÚMERO DE CRÉDITOS:	PERÍODO:
PRÉ-REQUISITOS	PRÉ OU CO-REQUISITOS
ERU 605	

EMENTA

Métodos dinâmicos em macroeconomia. Flutuações Econômicas. Modelo básico de ciclos econômicos reais. Extensões do modelo básico de ciclos econômicos reais. Estimação bayesiana de modelos DSGE.

CURSOS PARA OS QUAIS É MINISTRADA (SOMENTE PARA CURSOS DE GRADUAÇÃO)

1.	( )	7.	( )
2.	( )	8.	( )
3.	( )	9.	( )
4.	( )	10.	( )
5.	( )	11.	( )
6.	( )	12.	( )

(OB)= OBRIGATÓRIA (OP)= OPTATIVA

Nº DA ATA DA REUNIÃO: _____/_____ DATA DE APROVAÇÃO: _____/_____/_____

_____
CHEFE DO DEPARTAMENTO

ALTERAÇÃO APROVADA PELO ☐ CTP ☐ CTG	APROVAÇÃO DA COORDENAÇÃO DE ENSINO, PESQUISA E EXTENSÃO - CEPE
Nº DA ATA DA REUNIÃO _____/_____ DATA DE APROVAÇÃO: _____/_____/_____	Nº DA ATA DA REUNIÃO _____/_____ DATA DE APROVAÇÃO _____/_____/_____
_____ PRESIDENTE DO CONSELHO	_____ SECRETÁRIO DE ÓRGÃOS COLEGIADOS

UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA	PROGRAMA ANALÍTICO DE DISCIPLINA (continuação)	Nº FOLHA: RUBRICA:

DISCIPLINA: Teoria Macroeconômica III	CÓDIGO: ERU 706

UNIDADES E ASSUNTOS	☐ AULAS TEÓRICAS	☐ AULAS PRÁTICAS	Nº DE HORAS-AULA
1. Métodos dinâmicos em macroeconomia 1.1. Equações em diferenças estocásticas e cadeias de Markov 1.2. Método de Lagrange e programação dinâmica estocástica 1.3. Técnicas de log-linearização 1.4. Resolvendo um modelo linear de expectativas racionais 1.5. Funções de resposta a impulsos			12
2. Flutuações econômicas 2.1. Definição de ciclos econômicos 2.2. Fatos estilizados e mensuração 2.3. Perspectiva histórica dos ciclos econômicos 2.4. Primeiras abordagens teóricas			4
3. Modelo básico de ciclos econômicos reais 3.1. Modelo neoclássico de crescimento estocástico 3.2. Técnicas de solução 3.3. Calibração do modelo 3.4. Simulação mediante recursos computacionais 3.5. Avaliação dos resultados da simulação			8
4. Extensões do modelo básico de ciclos econômicos reais 4.1. Custos de ajustamento 4.2. Formação de hábitos de consumo 4.3. Moeda e inflação 4.4. Política fiscal 4.5. Modelo de pequena economia aberta			28
5. Estimação bayesiana de modelos DSGE 5.1. Solução (linearizada) de um modelo DSGE 5.2. Função de verossimilhança 5.3. “Priors” 5.4. Inferência bayesiana 5.5. Algoritmos Metropolis-Hastings			8

_____
CHEFE DO DEPARTAMENTO

UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA	REFERÊNCIAS BIBLIOGRÁFICAS	Nº FOLHA: RUBRICA:

DISCIPLINA: Teoria Macroeconômica III	CÓDIGO: ERU 706

BENASSY, J. P. **Macroeconomic Theory**. New York: Oxford University Press, 2011. 608 p.

CANOVA, F. **Methods for Applied Macroeconomic Research**. Princeton: Princeton University Press, 2007. 512 p.

CHACON, J. L. T. **Introduction to Dynamic Macroeconomic General Equilibrium Models**. 2nd. Revised Edition. Vernon Press, 2015. 286 p.

COOLEY, T. F. **Frontiers of Business Cycle Research**. Princeton: Princeton University Press, 1995. 464 p.

GALÍ, J. **Monetary Policy, Inflation, and the Business Cycle**: an Introduction to the New Keynesian Framework and its Applications. 2nd. Edition. Princeton: Princeton University Press, 2015. 296 p.

HERBST, E. P.; SHORFHEIDE, F. **Bayesian Estimation of DSGE Models**. Princeton: Princeton University Press, 2015. 296 p.

LJUNGQVIST, L.; SARGENT, T. J. **Recursive Macroeconomic Theory**. 3rd. Edition. Cambridge: The MIT press, 2012. 1320 p.

McCANDLESS, G. T. **The ABCs of RBCs**: an Introduction to Macroeconomic Models. Cambridge: Harvard University Press, 2008. 448 p.

MIAO, J. **Economic Dynamics in Discrete Time**. Cambridge: The MIT Press, 2014. 710 p.

WALSH, C. E. **Monetary Theory and Policy**. 3rd. Edition. Cambridge: The MIT Press, 2010. 640 p.

_____/_____/_____

_____

CHEFE DO DEPARTAMENTO