

APLICAÇÕES ECONOMETRÍCAS E PREVISÃO COM O EIEWS (IV EDIÇÃO)



Formador:

Jorge Caiado, Doutorado em Matemática Aplicada à Economia e à Gestão pela Universidade Técnica de Lisboa, Professor do ISEG e investigador do Centro de Matemática Aplicada à Previsão e Decisão Económica, autor de vários livros, artigos científicos e comunicações em conferências nacionais e internacionais nas áreas de estatística e econometria aplicada, análise de séries temporais e métodos de previsão.

Data: 18, 19 e 20 de Setembro de 2012

Duração: 21 horas

Horário: 9h00m – 17h00m

Local: ISEG, Lisboa

Preço:

1. Inscrições efectuadas até 30 dias antes da data de início do curso – Estudantes: €300 / Académicos: €450 / Outros: €550 (acresce IVA à taxa legal em vigor)
2. Inscrições efectuadas nos 30 dias antes da data de início do curso – Estudantes: €375 / Académicos: €575 / Outros: €675 (acresce IVA à taxa legal em vigor)

Destinatários:

Quadros técnicos e superiores de empresas públicas e privadas; Gestores da área financeira, comercial, pessoal, logística e planeamento; Economistas e analistas financeiros; Estudantes de licenciatura e pós-graduação; Docentes e Investigadores; Outros profissionais que pretendam uma formação qualificada neste domínio.

Programa:

1º Dia. Introdução ao EIEWS (primeiros passos; organização do ficheiro de trabalho; análise exploratória de dados; estatísticas de séries temporais; métodos de regressão; introdução aos métodos de previsão; modelos de médias móveis e de alisamento exponencial).

2º Dia. Econometria de Séries Temporais (modelos ARMA e ARIMA; metodologia de Box-Jenkins; modelos VAR; testes de estacionaridade; causalidade e cointegração; decomposição da variância e funções de resposta a impulsos; aplicações com séries económicas).

3º Dia. Modelos ARCH e Previsão de Séries Financeiras (modelos ARCH e GARCH; modelos GARCH-M); teste de efeitos ARCH/GARCH; modelos GARCH assimétricos; modelo Component-GARCH; distribuições dos erros; aplicações com séries financeiras).

Para mais informações, consulte <http://www.timberlake.pt/Training/index.php> ou contacte-nos no endereço cemapre@iseg.utl.pt.