



## CURSOS DE FORMAÇÃO

### *Aplicações econométricas e previsão com o Eviews*

Data: 7, 8 e 9 de Julho de 2010

Duração: 21 horas

Horário: 09h00m – 17h00m

Preço: 800,00 Euros + IVA (20%)

Local: Instituto Superior de Economia e Gestão

#### **Objectivos:**

Dotar os participantes com conhecimentos fundamentais sobre métodos estatísticos e econométricos; Dar a conhecer os principais métodos de previsão de séries económicas e financeiras; Proporcionar um conhecimento alargado das principais ferramentas de econometria e previsão do EViews e suas aplicações.

#### **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 EViews**

- 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 (TGARCH, EGARCH e PGARCH)
- Modelo Component-GARCH
- Distribuições dos erros (Normal, t-student e GED)
- Aplicações com séries financeiras

#### **Formador:**

Jorge Caiado - PhD em Matemática Aplicada à Economia e à Gestão; Investigador do Centro de Matemática Aplicada à Previsão e Decisão Económica do ISEG; Autor de vários livros e artigos científicos e comunicações em conferências nacionais e internacionais nas áreas de estatística e econometria aplicada, análise de séries temporais e métodos de previsão.