

## Reflexos da globalização financeira na economia brasileira: Uma aplicação do modelo GARCH multivariado e filtro de Kalman

Dr. Douglas Marcos Ferreira, Departamento de Ciências Econômicas - UFSJ



### Resumo da Palestra

As recentes crises financeiras trouxeram novos desafios para os Bancos Centrais das economias. A crise financeira internacional do *subprime* (2007/2008) forneceu claras evidências de que um ambiente econômico favorável antes de sua eclosão não impediu os desequilíbrios e as instabilidades no mercado financeiro das economias mundiais. Diante da intensificação do processo de globalização financeira, torna-se relevante analisar como a economia brasileira reagiu aos episódios de instabilidades financeiras mundiais. Com o intuito de verificar se a volatilidade do mercado financeiro americano foi transmitida para o mercado brasileiro durante a crise financeira do subprime, será utilizado o modelo GARCH multivariado. Por fim, com o intuito de verificar qual o comportamento do Banco Central do Brasil via taxa de juros diante de possíveis instabilidades financeiras, será estimada uma função de reação para modelar a taxa de juros através do filtro de Kalman.

### Biografia

Possui graduação em Ciências Econômicas pela Universidade Federal de São João del-Rei (2009), mestrado (2012) e doutorado (2016) em Economia Aplicada pela Universidade Federal de Viçosa. Atualmente é coordenador do Núcleo de Ensino, Pesquisa e Extensão em Economia (NEPE-UFSJ). Tem experiência na área de Economia, com ênfase em Métodos Quantitativos em Economia, Modelos Matemáticos, Econométricos e Estatísticos, atuando principalmente nos seguintes temas: modelos de volatilidade aplicados a dados financeiros, macroeconometria e inflação.

### Outras informações

- **Data:** 17/09/2019
- **Hora:** 17h00
- **Local:** 1.15 PAV - CSA
- Não é necessária a inscrição prévia.
- Após a palestra será servido um lanche.
- **Organização:** <https://ufsj.edu.br/gcom/>