

Seminário Internacional

Modelagem Econométrica e Financeira - OxMetrics™

31 de julho de 2001

(Participação Gratuita)

O *FinanceLab* das Faculdades Ibmec deseja convidá-lo para este seminário de um dia sobre o tema Modelagem Econométrica e Financeira usando OxMetrics™.

Tema

Avanços em séries temporais, previsão e engenharia de software estão sendo introduzidos continuamente. Esses avanços têm gerado inovações na modelagem de séries temporais com a introdução de softwares orientados a objetos e de fácil utilização pelo usuário final.

Objetivo

O seminário tem por objetivo apresentar aos participantes o conjunto de programas que compõem o OxMetrics, com atenção especial aos programas de data mining, modelagem de volatilidade estocástica, análise de séries temporais e integração do código do OxMetrics com aplicações corporativas existentes. Aplicações em Econometria e Finanças fazem parte integrante das apresentações.

Público-alvo

O seminário é destinado a pesquisadores, alunos e profissionais nas seguintes áreas:

- Pesquisa Econômica / Modelagem
- Modelagem Financeira / Operadores de Arbitragem
- Administração Quantitativa de Investimentos
- Administração de Risco
- Operadores de Derivativos
- Tecnologia da Informação
- Analistas Financeiros
- Professores e Pesquisadores de Instituições Acadêmicas

OxMetrics™

OxMetrics™ é o nome de uma família de programas computacionais. OxMetrics é uma solução integrada para profissionais que trabalham em modelagem de econometria de finanças, análise econométrica de séries temporais, previsão e análise estatística de dados de corte transversal e de painel. Os programas foram desenvolvidos por vários professores e pesquisadores que trabalham em pesquisa nas áreas de econometria, econometria de finanças, estatística e tecnologia de computação. Estes programas tem sido utilizados pela comunidade acadêmica e por profissionais ligados a institutos de pesquisa e instituições financeiras. OxMetrics™ apresenta as seguintes soluções:

- Últimos desenvolvimentos em técnicas de modelagem em econometria e finanças (por exemplo, volatilidade, modelos de mudanças de regime).
- Soluções a baixo custo.
- Integração simples com os sistemas existentes nas organizações.
- Suporte e treinamento disponível em várias partes do mundo.

FinanceLab

O FinanceLab, formado por professores e pesquisadores do Ibmec e de outras instituições assim como por profissionais de mercado, é um núcleo de pesquisa em Finanças, criado pelo Ibmec Educacional com o objetivo de produzir pesquisa teórica e aplicada. Desenvolve produtos ligados a finanças no Brasil, como, por exemplo o <http://www.risktech.com.br>.

Realização:



Apoio:



Timberlake Consultante

Palestrantes

Dr Jurgen Doornik é Research Fellow do Nuffield College, Universidade de Oxford. É PhD pela Universidade de Oxford. Ele é o responsável pelo desenvolvimento da linguagem Ox e contribuiu para diversos programas na família OxMetrics. Ele desenvolve juntamente com Prof. David Hendry o software PcGive. Artigos publicados em *Econometric Journal*, *Journal of Economic Surveys*, *Economic Journal* e *Scottish Journal of Political Economy*.

<http://nuff.ox.ac.uk/Users/Doornik>

Prof. Pedro Valls é Professor Titular de Econometria e Finanças das Faculdades Ibmecc e Coordenador do Ibmecc FinanceLab. É PhD pela London School of Economics (LSE) e sua tese foi orientada pelo Prof Andrew Harvey, um dos responsáveis pelo programa STAMP. Artigos publicados em *Econometric Theory*, *Economic Letters*, *The Brazilian Review of Econometrics*, *Revista Brasileira de Economia e Pesquisa e Planejamento Econômico*.

<http://pvalls.ibmecc.br>

Programa do Seminário

9:30 Inscrição

10:00 **Introdução à família de produtos do OxMetrics: GiveWin, Ox, PcGive, PcNaive, Stamp e PcGets**

Dr. Jurgen A. Doornik

11:30 Discussão

12:00 Almoço

13:00 **Modelagem em Espaço de Estado com aplicações em ciclos econômicos e mercados financeiros usando Stamp**

Prof. Pedro Valls

14:00 Discussão

14:30 Coffee Break

14:45 **Novas características do PcGive 10 e uma introdução ao PcGets com Aplicações**

Dr. Jurgen A. Doornik

16:00 Coffee Break

Demonstrações Complementares

16:30 Término

Local e data

Ibmecc Business School – Rua Maestro Cardim, 1170 – sobreloja.

31 de julho de 2001

Das 09:30 às 16:30

Inscrições

As inscrições devem ser feitas através da ficha anexa até sexta-feira, 27 de julho de 2001.

Realização:



Apoio:



Timberlake Consultante

Seminário Internacional
Modelagem Econométrica e Financeira - OxMetrics™
31 de julho de 2001
(Participação Gratuita)

Ficha de Inscrição

Nome: _____

e-mail: _____

Instituição: _____

Endereço: _____

Telefone: _____ Fax: _____

*Favor enviar esta ficha por e-mail ou fax
Vagas limitadas.*

Ibmec Business School S.A.
Rua Maestro Cardim 1170
01323-001, São Paulo, S.P.
Tel: +(011)+3175-2300
Fax: +(011)+287-9076
e-mail: financelab@risktech.com.br

Realização:



Apoio:



Timberlake Consultante