

173

MODELOS DE MUDANÇA MARKOVIANA APLICADOS À ECONOMIA BRASILEIRA.

Marcelo de Carvalho Griebeler, Marcelo Savino Portugal (orient.) (UFRGS).

Neste projeto, procura-se estender a experiência acumulada no campo dos métodos econométricos que permitem a estimação de relações econômicas com quebra estrutural, com a utilização de modelos de mudança de markov. A novidade é levar a linha de pesquisa até então usada à frente utilizando agora um método não-linear que permite a determinação endógena das quebras estruturais. O objetivo é avaliar a aplicabilidade da metodologia de mudança de regime a séries macroeconômicas do Brasil. Para tanto, este trabalho se divide em quatro partes. Na primeira será feita uma breve revisão da literatura econométrica sobre os conceitos de raiz unitária, estacionariedade, cointegração, modelos de vetores autoregressivos, heteroscedasticidade e mudança de regime markoviano. Posteriormente, pretende-se fazer uma aplicação desta metodologia de mudança de regime para a geração de três ensaios aplicados com dados brasileiros: o primeiro sobre demanda de importações; o segundo sobre Curva de Phillips; e o terceiro sobre estimação do *passthrough* para a economia brasileira. (PIBIC).