

**Nome do autor**

**Título do trabalho**

**Uberlândia**

**2023**

## SUMÁRIO

|              |   |          |
|--------------|---|----------|
|              | <b>Introdução</b> . . . . .   | <b>2</b> |
| <b>1</b>     | <b>REVISÃO DA LITERATURA</b> . . . . .                                      | <b>3</b> |
| <b>1.1</b>   | <b>Modelo IS-PC-MR Novo Keynesiano</b> . . . . .                            | <b>3</b> |
| <b>2</b>     | <b>ESTRUTURA FORMAL DO MODELO</b> . . . . .                                 | <b>4</b> |
| <b>2.1</b>   | <b>O Lado da Oferta, Marcação de Preços e a Curva de Phillips</b> . . . . . | <b>4</b> |
| <b>3</b>     | <b>METODOLOGIA BVAR E SIMULAÇÃO COMPUTACIONAL</b> . . . . .                 | <b>5</b> |
| <b>3.1</b>   | <b>Modelo de Vetores Auto-Regressivos Bayesianos (BVAR)</b> . . . . .       | <b>5</b> |
| <b>3.1.1</b> | <b>Modelo BVAR para a Economia Brasileira</b> . . . . .                     | <b>5</b> |
| <b>4</b>     | <b>ANÁLISE DE RESULTADOS</b> . . . . .                                      | <b>6</b> |
| <b>4.1</b>   | <b>Simulação computacional e Choques</b> . . . . .                          | <b>6</b> |
| <b>4.2</b>   | <b>Funções Impulso-Reposta</b> . . . . .                                    | <b>6</b> |
|              | <b>Considerações finais</b> . . . . .                                       | <b>8</b> |
|              | <b>REFERÊNCIAS</b> . . . . .  | <b>9</b> |

## INTRODUÇÃO

## 1 REVISÃO DA LITERATURA

### 1.1 Modelo IS-PC-MR Novo Keynesiano

## 2 ESTRUTURA FORMAL DO MODELO

### 2.1 O Lado da Oferta, Marcação de Preços e a Curva de Phillips

### 3 METODOLOGIA BVAR E SIMULAÇÃO COMPUTACIONAL

#### 3.1 Modelo de Vetores Auto-Regressivos Bayesianos (BVAR)

##### 3.1.1 Modelo BVAR para a Economia Brasileira

## 4 ANÁLISE DE RESULTADOS

### 4.1 Simulação computacional e Choques

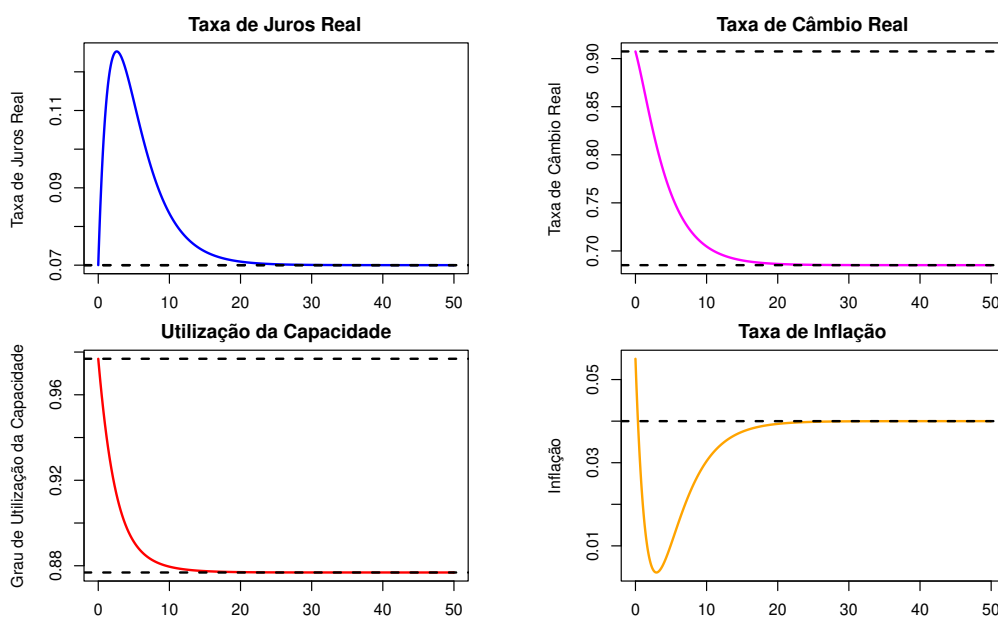
Tabela 1 – Parâmetros da Simulação

| Parâmetros | Valor      |
|------------|------------|
| $\omega_1$ | 0.4        |
| $\beta_2$  | 0.5        |
| $u_T$      | 0.8        |
| $p_T$      | 0.04       |
| $\phi$     | 0.5        |
| $\chi$     | 0.5        |
| $\alpha$   | 1.5        |
| $p_e$      | 0.04, 0.10 |
| $\mu$      | 0.35, 0.30 |
| $\omega_0$ | 0.35       |
| $r_e$      | 0.02       |
| $\sigma_0$ | 0.05, 0.15 |
| $g_e$      | 0.04       |
| $\kappa$   | 1.5        |
| $u_0$      | 0.4        |
| $u_1$      | 0.3        |
| $\gamma_1$ | 0.3        |
| $\zeta$    | 0.25       |

Elaborado pelo próprio autor

### 4.2 Funções Impulso-Reposta

Figura 1 – Choque em  $\uparrow p_e$  (0.04  $\rightarrow$  0.10)



Fonte: Elaborado pelo próprio autor



## CONSIDERAÇÕES FINAIS

## REFERÊNCIAS