

GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

Matrícula: 1803236 Nome: ADRIAN HERINGER PIZZINGA

Classe: PROFESSOR DO MAGISTERIO SUPERIOR - ADJUNTO

Nível 603

Titulação DOUTORADO-ENGENHARIA ELÉTRICA |

Reg. Trabalho Semanal DE

Assinatura : _____

Aprovado na reunião do Departamento de 3 de 3 de 2015

ANA MARIA LIMA DE FARIAS
 Chefe-Deptº Estatística
 SIAPE 0311506

Assinatura do Chefe do Departamento Ana Maria Lima de Farias

Visto do Diretor da Unidade Celso Costa Professor Celso Costa

Administração

Função ou Atividade	Tipo	Orgão	Ato de Designação	CH
PROFESSOR	REUNIÃO - DEPARTAMENTO, CONSELHOS, ETC	GET	null	14
PROFESSOR	COMISSAO PERMANENTE	GET	null	100

Aula

Período	Disciplina	Turma	Nível	Cod.Emec/Num Alunos	Carga Horária Anual			
					Teórica	Prática	Estági	Acess.
1/2014	ESTATÍSTICA BÁSICA PARA ENGENHARIA I	A1	GRA	12722-30	68	0	0	136
2/2014	MODELOS PROBABILÍSTICOS	A1	GRA	12722-17	60	0	0	120
2/2014	PROJETO FINAL I	A1	GRA	99082-17	2	0	0	50
1/2014	TEORIA DAS PROBABILIDADES I	A1	GRA	99082-32	102	0	0	204
2/2014	TEORIA DAS PROBABILIDADES II	A1	GRA	99082-25	102	0	0	204

Ensino

Resumo da Atividade	Projeto de Ensino	Carga Horária Anual	
		Atividade	Acessória
ENCONTROS SEMANAIS COM O MONITOR DA DISCIPLINA PARA ELABORAÇÃO DAS AULAS DE EXERCÍCIOS.	GETP0003-2014: AULAS DE EXERCÍCIOS PARA PROBABILIDADE I	10	10

Especial

Descrição	Instituição	Carga Horária Anual	
		Atividade	Acessória
PARTICIPAÇÃO EM BANCA DE DEFESA DE DISSERTAÇÃO DE Mestrado de Carolina Nascimento Nogueira de Janeiro Lima.	PONTIFÍCIA UNIVERSIDADE CATÓLICA DO RIO DE JANEIRO	3	50
PARTICIPAÇÃO EM BANCA DE DEFESA DE TRABALHO DE CONCLUSÃO DE CURSO DE Sergio Felipe Abreu de Brito Bastos.	UNIVERSIDADE FEDERAL FLUMINENSE	2	50
ESTE DOCENTE REALIZOU ATIVIDADES RELACIONADAS À CONFECÇÃO E À PUBLICAÇÃO DE 1 ARTIGO CIENTÍFICO. OS DETALHES ESTÃO LISTADOS NA SEÇÃO DE PRODUTOS.	UNIVERSIDADE FEDERAL FLUMINENSE	200	0

GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA
Extensão

Resumo da Atividade	Projeto de Extensão	Carga Horária Anual	
		Atividade	Acessória
Registro importado	Consultorias do Laboratório de Estatística - 2014	60	0

Orientação Externa

Aluno	Semestr	Tipo	Nível	Curso
CARLOS EDUARDO DE MOURA	ANUAL	DISSERTAÇÃO DE MESTRADO	MES	Mestrado em Métodos Matemáticos em Finanças

TOTAL DE HORAS DE ORIENTAÇÃO
100
Produto(s)
Produto : 1

Departamento:	DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA	Perfil	Participante
Projeto:			
Título do produto:	Yield Curve Forecasts and the Predictive Power of Macro Variables in a VAR Framework		
Idioma	INGLÊS		
País:	ESTADOS UNIDOS(USA)		
Tipo de produto:	ARTIGO EM PERIÓDICO INTERNACIONAL COM CORPO EDITORIAL		
Ano de publicação:	2014		
Área de	ESTATISTICA		
Referência	<p>Ang, A. and Bekaert, G., 2002, Regime switches in interest rates, Journal of Business & Economic Statistics, vol. 20(2), 163-182.</p> <p>Ang, A. and Piazzesi, M., 2003, A no-Arbitrage vector autoregression of term structure dynamics with macroeconomic and latent variables, Journal of Monetary Economics, vol. 50, no. 4, 745-787.</p> <p>Ang, A., Piazzesi, M. and Wei, M., 2006, What does the yield curve tell us about GDP growth?, Journal of Econometrics, 131, 359-403.</p> <p>Bernanke, B., Gertler, M. and Watson, M., 1997, Systematic monetary policy and the effects of oil price shocks, Working Paper 97-25, C.V. Starr Center for Applied Economics, New York University.</p> <p>Campbell, J., 1998, Some lessons from the yield curve, Journal of Economic Perspectives, vol. 9(3), 129-152.</p> <p>Campbell, J. and Shiller, R., 1991, Yield spreads and interest rate movements: a bird's eye view, Review of Economic Studies, vol. 58(3), 495-514.</p> <p>Chan, K., Karolyi, A., Longstaff, F. and Sanders, A., 1992, The volatility of short-term interest rates: an empirical comparison of alternative models of the term structure of interest rates, The Journal of Finance, vol. 47, no 3, 1209-1227.</p> <p>33</p> <p>Christiansen, C. and Lund, J., 2002, Revisiting the shape of the yield curve: the effect of interest rate volatility, EFA 2002 Berlin Meetings Presented Paper, 2002.</p> <p>Clarida, R., Gali, J. and Gertler, M., 1998, Monetary policy rules in practice: some international evidence, European Economic Review, XLII, 1033-1068.</p> <p>Clarida, R., Gali, J. and Gertler, M., 1999, The science of monetary policy: a new Keynesian perspective, Journal of Economic Literature, vol. 37(4), 1661-1707.</p> <p>Cochrane, J. and Piazzesi, M., 2005, Bond risk premia, American Economic Review, vol. 95(1), 138-160.</p> <p>Dewachter, H. and Lyrio, M., 2006, Macro factors and the term structure of interest rates, Journal of Money, Credit, and Banking, vol. 38 (1), 119 -140.</p> <p>Dewachter, H., Lyrio, M. and Maes, K., 2006, A joint model for the term structure of interest rates and the macroeconomy, Journal of Applied Econometrics, vol. 21, no 4, 439-462.</p> <p>De Pooter, M., 2007, Examining the Nelson-Siegel class of term structure models, Tinbergen Institute Discussion Papers 07-043/4.</p> <p>Diebold, F. and Li, C., 2006, Forecasting the term structure of government bond yields, Journal of Econometrics, vol. 130, 337-364.</p> <p>Diebold, F. and Mariano, R., 1995, Comparing predictive accuracy, Journal of Business and Economic Statistics, 13, 253-263.</p>		

Produto(s)

34

Diebold, F., Rudebusch, G. and Aruoba, S., 2006, The macroeconomy and the yield curve: a dynamic latent factor approach, Journal of Econometrics, vol. 127(1-2), 309-338.

Duffee, G., 2002, Term premia and interest rate forecasts in affine models, Journal of Finance, 57, 405-443.

Engle, R. and Ng, V., 1993, Time-varying volatility and the dynamic behavior of the term structure, Journal of Money, Credit and Banking, vol. 25(3), 336-349.

Estrella, A., 2005, Why does the yield curve predict output and inflation?, Economic Journal, vol. 115, 722-744.

Estrella, A. and Hardouvelis, G., 1991, The term structure as a predictor of real economic activity, Journal of Finance, 46, 555-576.

Estrella, A. and Mishkin, F., 1997, The predictive power of the term structure of interest rates in Europe and the United States: implications for the European Central Bank, European Economic Review, 41, 1375-1401.

Evans, C. and Marshall, D., 1998, Monetary policy and the term structure of nominal interest rates: evidence and theory, Carnegie-Rochester Conference Series on Public Policy, vol. 49, 53-111.

Evans, C. and Marshall, D., 2002, Economic determinants of the nominal treasury yield curve, Working Paper 2001-16, Federal Reserve Bank of Chicago.

Hall, A., Anderson, H. and Granger, C., 1992, A cointegration analysis of treasury bill yields, Review of Economics and Statistics, vol. 74, no. 1, 116-126.

35

Hamilton, J., 1988, Rational-expectations econometric analysis of changes in regime: an investigation of the term structure of interest rates, Journal of Economic Dynamics and Control 12, 385-423.

Hördahl, P., Tristani, O. and Vestin, D., 2006, A joint econometric model of macroeconomic and term structure dynamics, Journal of Econometrics, vol. 127, 405-444.

Kozicki, S., 1997, Predicting real growth and inflation with the yield spread, Federal Reserve Bank of Kansas City Economic Review, 82, 39-57.

Litterman, R. and Scheinkman, J., 1991, Common factors affecting bond returns, Journal of Fixed Income, vol. 1, 44-51.

Litterman, R., Scheinkman, J. and Weiss, L., 1991, Volatility and the yield curve, Journal of Fixed Income, vol. 1, 49-53.

Mishkin, F., 1998, The information in the term structure: some further results, Journal of Applied Econometrics, Volume 3, Issue 4, 307-314.

Sims, C., Stock, J. and Watson, M., 1990, Inference in linear time series models with some unit roots, Econometrica, volume 58, issue 1, 113-144.

Sims, C. and Uhlig, H., 1991, Understanding unit rooters: a helicopter tour, Econometrica, volume 59, issue 6, 1591-1599.

Stock, J. and Watson, M., 2000, Forecasting output and inflation: the role of asset prices, manuscript, Kennedy School of Government (revised January 2003).

36

Svensson, L., 1994, Estimating and interpreting forward interest rates: Sweden 1992-1994, IMF Working Paper 94/114, available at SSRN: <http://ssrn.com/abstract=883856>.

Taylor, J., 1993, Discretion versus policy rules in practice, Carnegie-Rochester Conference Series on Public Policy, 39, 195-214.

Woodford, M., 2003, Interest and prices, Princeton University Press.

Wu, T., 2001, Stylized facts on nominal term structure and business cycles: an empirical VAR approach, Working Paper 2002-08, Federal Reserve Bank of San Francisco.

Projeto(s)

Projeto: 1

Tipo: PROJETO DE ENSINO

Perfil: Responsável

Título: GETP0003-2014: AULAS DE EXERCÍCIOS PARA PROBABILIDADE I

Departamento: DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

Curso: ESTATÍSTICA

Data 08/01/2014 Financiamento NÃO POSSUI

Data inicial: 08/01/2014

Data final: 12/12/2014

Moeda: SELECIONAR

Valor: 0

Resumo: PROJETO DO PROGRAMA DE MONITORIA 2014

ESTE PROJETO SE CARACTERIZA PELA ELABORAÇÃO E EXECUÇÃO DE AULAS DE EXERCÍCIOS PARA OS ALUNOS DE PROBABILIDADE I DO CURSO DE ESTATÍSTICA.

O ASSUNTO EM CADA AULA DE EXERCÍCIO SERÁ SELECIONADO PELO MONITOR E PELO ORIENTADOR, QUE SERÁ O PROFESSOR DA DISCIPLINA. COM ISSO ESPERA-SE UMA SINCRONIA ENTRE AS AULAS TEÓRICAS, DADAS PELO ORIENTADOR, E AS

GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

Projeto(s)

AULAS DE EXERCÍCIOS, DADAS PELO MONITOR. A FREQUÊNCIA DAS AULAS DE EXERCÍCIOS SERÁ DE PELO MENOS UMA HORA SEMANAL. DESSA FORMA PRETENDE-SE ATINGIR DOIS OBJETIVOS PRINCIPAIS:
1) OFERECER AOS ALUNOS DA DISCIPLINA UMA ATIVIDADE CONTÍNUA AO LONGO DO SEMESTRE, DE FORMA QUE TODOS ESTEJAM SEMPRE PRATICANDO E ESTUDANDO A MATÉRIA;
2) OFERECER AO MONITOR A OPORTUNIDADE DE DAR AULAS, ESPERANDO-SE COM ISSO ESTIMULAR SUA CAPACIDADE DE APRESENTAÇÃO EM PÚBLICO E COMUNICAÇÃO ORAL.

Projeto: 2

Tipo: PROJETO DE EXTENSÃO Perfil: Colaborador
Título: Consultorias do Laboratório de Estatística - 2014

Departamento: DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

Curso:

Data Financiamento PROEX

Data inicial: 01/01/2014

Data final: 31/12/2014

Moeda:

Valor:

Resumo: NOSSA PROPOSTA É OFERECER ASSESSORIA ESTATÍSTICA PARA ALUNOS, PESQUISADORES OU PROFISSIONAIS ADMINISTRATIVOS QUE PROCURAREM O DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA PARA SOLICITAR ANÁLISES ESTATÍSTICAS. TAL ASSESSORIA SERÁ REALIZADA POR PROFESSORES DO DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA. - PROTOCOLO:167628.782.156256.23122013 -- EDITAL:FLUXO CONTÍNUO 2014 -- ÁREA TEMÁTICA:TECNOLOGIA E PRODUÇÃO