

Econometria III

Professor Thiago Morello

Lista de exercícios 3

Data de entrega: conforme plano de ensino

Q.1) No arquivo “dados_lista_3”, há dois objetos, “series_reais” e “series_monetarias”. Utilize, para esta questão a série “pib” do objeto “series_reais”. Aplique o teste de raízes unitárias aumentado de Dickey Fuller (“teste ADF”), partindo de 20 defasagens e reduzindo-as progressivamente até obter resíduos que não se comportem como ruídos brancos. Reporte, apresentando código do R e justificativas:

Q.1.a) O número de defasagens selecionado;

Q.1.b) Quais termos deterministas foram mantidos, se algum;

Q.1.c) A estatística do teste ADF;

Q.1.c) O resultado do teste ADF: há ou não uma raiz unitária?

Q.2) Repetir a questão 1 acima para a série temporal de gasto governamental (série valor.G, objeto “series_reais”);

Q.3) Repetir a questão 1 acima para a série temporal de despesa de consumo das famílias (série valor.C, objeto “series_reais”);

Q.4) Repetir a questão 1 acima para a série temporal de índice de inflação (série IPC_FIPE, objeto “series_monetárias”);

Q.5) Repetir a questão 1 acima para a série temporal de índice taxa de câmbio entre Real brasileiro e Dólar americano (série cambio_dolar, objeto “series_monetárias”);

Q.6) Aplique o teste de Phillips-Perron à série de índice de inflação, reportando a estatística do teste, p-valor e decisão quanto à hipótese de ausência de raiz unitária;

Q.7) Repita a questão 2 agora para a série de câmbio Real-Dólar.

Q.8) Aplique o teste de Dickey-Pantula à série de câmbio Real-Dólar, reportando:

Q.8.a) A estatística do teste para a presença de três raízes unitárias;

Q.8.b) O resultado do teste para a presença de três raízes unitárias;

Q.8.c) A estatística do teste para a presença de duas raízes unitárias;

Q.8.d) O resultado do teste para a presença de duas raízes unitárias;

Q.8.e) A estatística do teste para a presença de uma raiz unitária;

Q.8.f) O resultado do teste para a presença de uma raiz unitária;