

# Econometria Avançada - 2015-1

## Segunda lista de exercícios

O arquivo `macro.csv` contém as seguintes séries macroeconômicas mensais brasileiras.

- **Taxa de câmbio:** R\$/US\$ - comercial - compra - média - R\$.
- **Taxa de juros:** Over/Selic (% a.m.).
- **Taxa de desemprego aberto:** Região Metropolitana de São Paulo.
- **Salário mínimo real:** Série em reais (R\$) constantes do último mês deflacionando-se o salário mínimo nominal pelo INPC .
- **PIB:** R\$ (milhes).
- **Inflação:** Índice Nacional de Preos ao Consumidor Amplo (% a.m.) .

Ajuste modelos  $ARIMA(p, d, q)$  para cada uma dessas séries. Lembre-se que os critérios AIC e SIC servem para comparar modelos ARIMA quanto as escolhas de  $p$ ,  $q$  e  $d$ . Entretanto, não se esqueça que é sempre recomendável a implementação dos testes de Box-Pierce e Ljung-Box para os resíduos dos modelos pois os mesmos testam a ausência de correlação serial (algum “sinal”) deixada(o) no ruído.