**Instruções para tratamento dos dados**

**Observações gerais**

* O modelo é um modelo real, portanto, as séries devem ser deflacionadas.
* Não usar variáveis em números índices. Neste caso Y ≠ C?
* Variáveis com tendência (como consumo e PIB): dada a tendência, devemos fazer um mapeamento entre os dados não-estacionários (da base de dados) para uma variável estacionária (como é no modelo).
* Taxa de juros normalmente é medida em termos anuais e, portanto, devemos ajustar a frequência para corresponder ao modelo.

**Ajuste sazonal**

Modelos DSGE são feitos para capturar variações no ciclo de negócios, não lidam bem com padrões sazonais. Portanto, **os dados devem ser ajustados sazonalmente.** Ajuste sazonal tipicamente é feito usando alguma variação de X11. Esse procedimento pode ser obtido em:

<https://www.census.gov/srd/www/x13as/>

**Retirada de tendência**

Modos comuns de retirar tendência:

1. Filtro HP one-sided (Stock and Watson, 1999).
2. Tendência linear (King and Rebelo, 1999).
3. Filtro de primeira diferença (Smets and Wouters, 2007).

Questão importante:Estes métodos diferem quanto à média incondicional da variável sem tendência, em alguns casos a variável terá média incondicional igual a zero, em outros casos, não. Aqui você tem que considerar como as variáveis do modelo são reportadas, retira-se a média também ou é mantida?

Referências para os métodos:

(2018) Pfeifer - Seção 4.

(2007) DeJong, Dave - Seção 3.1.