

Taxa de juros diária EUA

Interest rates

Taxas diárias do Conselho dos Governadores do Federal Reserve. Nos Estados Unidos, a autoridade para definir as taxas de juros é dividida entre o Conselho de Governadores do Federal Reserve (Conselho) e o Comitê Federal de Mercado Aberto (FOMC). O Conselho decide sobre mudanças nas taxas de desconto após recomendações apresentadas por um ou mais dos Federal Reserve Banks regionais. O FOMC decide sobre as operações de mercado aberto, incluindo os níveis desejados de moeda do banco central ou a taxa de mercado de fundos federais desejada.

Bancos de dados disponíveis em:

<https://www.alphacast.io/p/luciano/charts/financial-usa-frb-interest-rates-daily-6869>

<https://www.alphacast.io/datasets/financial-usa-frb-interest-rates-daily-5824>

Indicador de inflação USA

CPI (Consumer Price Index)

Indicador que mede a inflação de preços ao consumidor nos EUA

Bancos de dados disponíveis em:

<https://www.bls.gov/cpi/data.htm>

<https://www.alphacast.io/repositories/bureau-of-labor-statistics-bls-402>

PMI (Purchasing Manager's Index) Industrial do ISM Manufacturing and Services.

Índice econômico que mensura as condições de negócios do setor industrial. Não restringe apenas as empresas do setor privado, mas todas as listadas na NAICS (Sistema Norte-Americano de Classificação de Setores).

Bancos de dados disponíveis em:

<https://www.alphacast.io/repositories/institute-for-supply-management-ism-4876>

Outras bases para explorar

- Acesso ao API da Bureau of Labor Statistics' (BLS):
<https://www.bls.gov/developers/home.htm>
- Acesso as bases de dados do Federal Reserve System:
<https://www.federalreserve.gov/data.htm>
- Acesso ao data lake do IHS Markit:
<https://ihsmarkit.com/products/data-package-list.html>

North American Industry Classification System (NAICS)

é o padrão usado pelas agências federais de estatística na classificação de estabelecimentos comerciais com a finalidade de coletar, analisar e publicar dados estatísticos relacionados à economia empresarial dos EUA.

Bancos de dados disponíveis em:

<https://www.census.gov/naics/>

Indicador de volatilidade

Recurrence Quantification Analysis – RQAs

São métricas de análise de quantificação de recorrência dos Recurrence Plots, elas detectam muito bem as dependências determinísticas em séries temporais e são indicadas para modelagem de séries financeiras e econômicas, uma vez que não requerem suposições sobre estacionariedade, distribuição estatística e número mínimo de observações.

<https://search.r-project.org/CRAN/refmans/RHRV/html/RQA.html>

Podemos focar nas métricas abaixo:

Taxa de Recorrência (REC) - Mede a densidade dos pontos de recorrência no gráfico de recorrência e é definida como

$$REC = \frac{1}{N^2} \sum_{i,j=1}^N \bar{R}_{i,j}^{m,\varepsilon}$$

Percentual de pontos recorrentes dentro do limiar escolhido. Varia de 0 a 1.

Determinismo (DET) - Razão entre o número de pontos de recorrência que formam as estruturas diagonais e todos os pontos de recorrência. Está relacionado com a previsibilidade do sistema e é definido como

$$DET = \frac{\sum_{l=l_{\min}}^N lP^{\varepsilon}(l)}{\sum_{i,j}^N \bar{R}_{i,j}^{m,\varepsilon}},$$

em que, $l = \{l_i; i=1...Nl\}$ representa a distribuição de frequência dos comprimentos l das estruturas diagonais no gráfico de recorrência e Nl é o número absoluto de linhas diagonais.

Laminaridade (LAM) - Razão entre os pontos de recorrência que formam as estruturas verticais e todo o conjunto de todos os pontos de recorrência presentes no gráfico e é definida como:

$$LAM = \frac{\sum_{v=v_{\min}}^N vP^{\varepsilon}(v)}{\sum_{i,j}^N \bar{R}_{i,j}^{m,\varepsilon}},$$