

Econometria de Séries Temporais*

Trabalho

João Ricardo Costa Filho

Em grupo com até **quatro integrantes**, vocês devem escolher (apenas) um dos tipos de trabalho propostos: **análise de conjuntura econômica**, **análise do setorial**, **pesquisa bibliográfica** e **replicação de um artigo acadêmico**.

Análise de conjuntura econômica

Desafio proposto pelo Gustavo Ribeiro (Economista Sênior – Gávea Investimentos):

"O México tem, historicamente, uma dependência e interligação muito forte do seu crescimento com o crescimento dos EUA. Nos últimos anos, isto foi, de um lado, amplificado pelo fenômeno de "nearshoring" das cadeias de produção e, de outro, há fatores internos que parece ter suportado um maior dinamismo do consumo, como crescimento monumental do salário mínimo nos últimos anos, um leve financial deepening, etc. Um possível exercício seria decompor o crescimento mexicano nos últimos anos em fatores domésticos e externos, por exemplo, usando um VAR com restrições do tipo 'block exogeneity'."

Portanto, o grupo deve realizar uma decomposição das fontes de crescimento do México.

Entregáveis: apresentação com a análise e um Jupyter Notebook com os códigos que suportam as análises na apresentação.

Análise do setorial

Desafios propostos pelo Marco Caruso (Economista-chefe – PicPay)

"Entender a relação desvalorização dólar versus produção industrial (exportamos mais, mas encarece maquinário que é complementar à produção)."

"[Existem] possíveis efeitos secundários da agropecuária nos serviços e na indústria? A lógica é que o PIB agro "supostamente" transborda pra outros setores (serviços de transportes?)"

*joaocostafilho.com.

"Quem sente mais com a mudança nos juros? Estudar o efeito e o "lag" dos juros em cada setor, quem sente mais, quem sente antes uma mudança nos juros."

"O Ibre/FGV faz uma divisão das aberturas do PIB pela oferta: cíclicos e não cíclicos. Seria interessante sistematizar e analisar os comportamentos dessas aberturas."

"O Ibre/FGV faz, na pesquisa do comércio, subsetores 'mais sensíveis à crédito' e 'mais sensíveis à renda'. Seria interessante sistematizar e analisar os comportamentos dessas aberturas."

O grupo deve escolher **apenas um** desses desafios.

Entregáveis: apresentação com a análise e um Jupyter Notebook com os códigos que suportam as análises na apresentação.

Pesquisa bibliográfica

Neste formato, cada grupo deverá escolher um tema diferente (não pode haver dois grupos com o mesmo tema) e realizar a revisão da literatura (com um quadro-síntese no qual apresenta os autores e o ano, a amostra, as variáveis, o método e as conclusões) de artigos acadêmicos publicados (no mínimo dez artigos para cada tema) para os seguintes temas:

- Multiplicador fiscal no Brasil.
- Elasticidade das receitas do governo à variação do PIB.
- Canais de transmissão da política monetária no Brasil.
- Taxa de juros natural no Brasil.
- Taxa de desemprego natural no Brasil.

Entregáveis: apresentação com a revisão da literatura (com um quadro-síntese da mesma).

Replicação de artigo

O grupo escolherá (com aval do professor) um artigo para replicarem os principais resultados (o professor indicará ao grupo quais resultados devem ser replicados quando der o aval para o mesmo sobre o artigo). A proposta de artigo deve partir do grupo.

Entregáveis: apresentação com a análise dos resultados do artigo e um Jupyter Notebook com os códigos que suportam as análises na apresentação.