

Econometria de Séries Temporais*

Trabalho

João Ricardo Costa Filho

Em grupo com até **quatro integrantes**, vocês devem escolher (apenas) um dos três desafios propostos abaixo.

Análise de conjuntura econômica

Desafios propostos pela Juliana Benedeti (Economista – Genoa Capital):

[T]odos nós economistas subestimamos muito o crescimento dos últimos anos. Provavelmente isso está relacionado à dificuldade de mensuração do impulso fiscal. Minha sugestão é criar um modelo de decomposição do crescimento do PIB em: impulso fiscal, monetário, crescimento mundial, commodities... Ou mesmo pensar em hipóteses alternativas pra medir esse impulso.

[D]ecompor o impulso fiscal. Gastos que têm maior multiplicador fiscal (os relacionados a renda/benefícios assistenciais) e outros com menor multiplicador. Também seria legal incluir as despesas dos Estados. São raros os exercícios que levam as contas públicas regionais em consideração.

Estudar um pouco da relação do déficit em conta corrente com crescimento acima/abaixo do potencial. O contexto é que estamos diante de uma situação que parece estar "vazando crescimento" pra fora. O nosso balanço de pagamentos está claramente mostrando uma deterioração na ponta. Seria interessante estudar o quanto desse movimento tem relação com o tempo que a economia está rodando com hiato apertado/ ou com a magnitude desse hiato.

*joaocostafilho.com.

Entregáveis

- **Apresentação:** Uma apresentação clara e concisa que exponha suas conclusões com base na análise dos artigos e dados.
- **Códigos:** Jupyter notebook permitindo replicar os resultados apresentados.

Importante: serão considerados na avaliação a estética do trabalho entregue (bem como o “storytelling”), a adequação do método escolhido para responder à pergunta proposta, implementação do método (seleção e obtenção de variáveis, estratégia de identificação dos parâmetros e a análise e exposição dos resultados) e as conclusões (em adequação com os itens anteriores e com a proposta do trabalho). Cada grupo (com até quatro integrantes) deverá entregar, necessariamente, dois arquivos: (i) um arquivo com a apresentação da análise (necessariamente, em formato .pdf; não serão aceitos links para arquivos) e (ii) um arquivo com o racional da análise (“as contas fetas”), que podem ser códigos, “Jupyter notebooks” (‘.ipynb’), planilhas (por exemplo .xlsx), etc; não serão aceitos links para arquivos). Cada um dos arquivos deve ser nomeado da seguinte forma:

- Arquivo com a análise: “NomeIntegrante1NomeIntegrante2NomeIntegrante3NomeIntegrante4.pdf” onde “NomeIntegrantej” representa o nome da(o) integrante(o) $j \in \{1, 2, 3, 4\}$ do grupo. Exemplo: em um grupo com dois integrantes, João e Ricardo, ficaria assim: “JoãoRicardo.pdf”.
- Arquivo com os códigos (e.g. Jupyter notebook): “NomeIntegrante1NomeIntegrante2NomeIntegrante3NomeIntegrante4.ipynb” onde “NomeIntegrantej” representa o nome da(o) integrante(o) $j \in \{1, 2, 3, 4\}$ do grupo. Exemplo: em um grupo com dois integrantes, João e Ricardo, ficaria assim: “JoãoRicardo.ipynb”.

Caso os arquivos não sejam entregues, até o prazo máximo para a entrega, nesse formato, o grupo perderá um ponto na nota final da AC.