

Homework 3 - Adv. Macro 1

Davi Jorge

Table of contents

1 Homework 4 - Adv. Macro 1

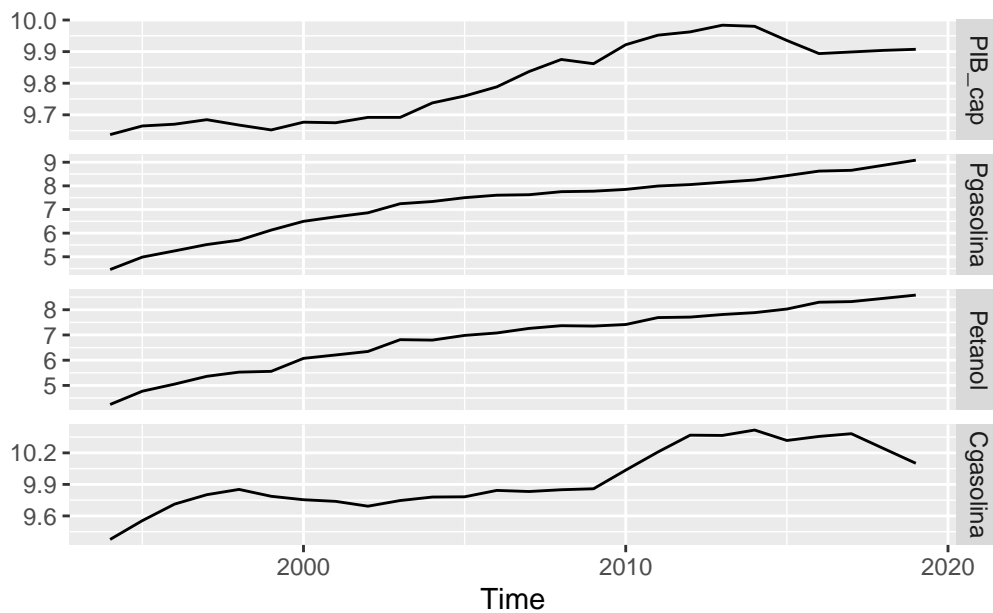
Link com códigos: [GitHub -Adv Macro](#)

Questão 1. De posse da base de dados data_vec_alunos.xls, disponível na pasta da turma, estime um modelo VEC e calcule as elasticidades de curto e longo prazos da demanda de gasolina.

- Aplique a metodologia Engle-Granger como visto em sala de aula e compare seus resultados com Alves and Bueno (2003).

1.0.1 Resposta:

1.0.1.1 Método Engle-Granger



Foi realizado testes de integração nas series e encontrei que as séries são $I(2)$. Os testes foram feitos a partir do teste de raiz unitária Dickey Fuller Aumentado.

Call:

```
lm(formula = dados_log$Cgasolina ~ t + t2 + dados_log$PIB_cap +
    dados_log$Pgasolina + dados_log$Petanol)
```

Residuals:

Min	1Q	Median	3Q	Max
-0.23330	-0.03627	0.01522	0.06858	0.20672

Coefficients:

	Estimate	Std. Error	t value	Pr(> t)
(Intercept)	13.011827	11.437952	1.138	0.2687
t	0.132206	0.110606	1.195	0.2460
t2	-0.001884	0.001885	-0.999	0.3295
dados_log\$PIB_cap	-0.233653	1.084191	-0.216	0.8316
dados_log\$Pgasolina	-0.776386	0.401886	-1.932	0.0677
dados_log\$Petanol	0.513779	0.362107	1.419	0.1713

Signif. codes: 0 '***' 0.001 '**' 0.01 '*' 0.05 '.' 0.1 ' ' 1