

Um Estudo de Séries Temporais: Uma aplicação para dados de inflação

Carlos Ayallas de Sousa Pereira¹, Gleydson Costa de Araujo², Valmaria Rocha da Silva Ferraz³, Tito Livio da Cunha Lopes⁴, Zeferino Gomes da Silva Neto⁵

Resumo: A inflação é um dos termos mais discutidos economicamente no mundo e o estado tem o dever de controlá-la. A inflação brasileira dividiu-se em dois momentos: antes e após o plano real, antes a inflação atingiu valores altíssimos e após a implantação do plano real o governo brasileiro conseguiu estabilizar as taxas inflacionárias. Tendo em vista a importância do termo econômico, este trabalho propõe avaliar a inflação medida pelo índice geral de preços do mercado (IGP-M). Para tal utilizou-se a metodologia de Box-Jenkins, propondo um modelo para previsões. Foram utilizados dados distribuídos mensalmente de janeiro de 1996 à dezembro de 2018. Por meio da análise de resíduos, constatou-se que os modelos propostos satisfaziam todos os pressupostos para uma boa previsão. A presença de valores influentes nos dados iniciais obrigou a substituição de tais para que o modelo pudesse ser ajustado novamente. Após a substituição optou-se pelo modelo AR(1) com intercepto pelos critérios AIC, BIC, EQM e EAM. O modelo mesmo satisfazendo todos os testes, não se mostrou satisfatório na previsão de 5 meses adiante, tendo em vista os valores já observados em 2019.

Palavras-chave: Inflação; Séries Temporais; Previsão.

¹ Universidade Federal de Viçosa-DET. email: carlosayallas@hotmail.com.

² Universidade Federal do Piauí-DET. email: gleydsonaraujo26@gmail.com.

³ Universidade Federal do Piauí-DET. email: valmaria@ufpi.edu.br.

⁴ Universidade Federal do Piauí-DET. email: titolivio@gmail.com.

⁵ Universidade Federal de Viçosa-DET. email: zeferinon@gmail.com.