

Macroeconometria usando o R

Lista de Exercícios 09

Vítor Wilher

4 de Abril de 2017

Resumo

Na aula entendemos um pouco melhor o processo gerador do PIB. Vamos estender esse entendimento na lista de exercícios.

Exercícios sugeridos

1. Considere a parte aumentada do Teste DF e utilize o protocolo de Pfaff (2008) para fazer o mesmo exercício visto na seção.
2. Teste se o hiato do produto se parece com um ruído branco.
3. Obtenha a variação marginal, trimestral e acumulada em quatro trimestres das séries do PIB.
4. Com base na variação acumulada em quatro trimestres, calcule a taxa de crescimento do PIB potencial e o hiato entre o crescimento do PIB efetivo e o do PIB potencial.

Referências

Pfaff, B. *Analysis of integrated and cointegrated time series with R*. Springer, New York, second edition, 2008.