

Curso de Macroeconometria usando o R

Lista de Exercícios 15

Vítor Wilher

8 de Agosto de 2017

Resumo

Na aula 15 do nosso curso, vimos como verificar se existe cointegração entre duas séries. Na lista, vamos praticar um pouco.

Exercícios Sugeridos

1. Verifique se a série de desembolsos do BNDES e a Taxa de Investimento, vistas na seção anterior do curso, se cointegram;
2. No exercício da seção 14, construímos um modelo de correção de erros com a receita como variável dependente. Faça o caso contrário;
3. Baixe o número índice do Índice de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) e deflacione as séries de receita e despesa do governo central;
4. Construa as séries acumuladas em 12 meses **real** das receitas e despesas do governo central;
5. Construa as séries de crescimento interanual com base nas séries que você construiu no item anterior;
6. Com essas séries de crescimento interanual, verifique se as mesmas são estacionárias;
7. Faz sentido investigar cointegração entre as séries do item anterior?
8. Investigue causalidade entre essas séries de crescimento interanual.