

Macroeconometria usando o R

Lista de Exercícios 10

Vítor Wilher

12 de Abril de 2017

Resumo

Na aula entendemos a metodologia Box-Jenkins, aplicada à produção industrial. Aqui, vamos praticar um pouco.

Exercícios sugeridos

1. Com base nos modelos gerados na aula, calcule as variações mensais, interanuais e acumuladas em 12 meses da produção industrial.
2. Talvez seja interessante adicionar variáveis supostamente exógenas aos nossos modelos univariados, gerando modelos do tipo ARIMAX.¹ Pede-se que você adicione algumas variáveis que você considera adequadas aos modelos gerados.
3. Com base nas variáveis exógenas adicionadas anteriormente, adicione cenários para um horizonte de h passos às mesmas e gere previsões com os modelos ARIMAX.
4. Compare as métricas fornecidas pela função `accuracy` nos modelos univariados como os modelos com variáveis exógenas.

¹Sobre esses modelos, ver <http://robjhyndman.com/hyndsight/arimax/>.