

Curso de Macroeconometria usando o R

Lista de Exercícios 13

Vítor Wilher

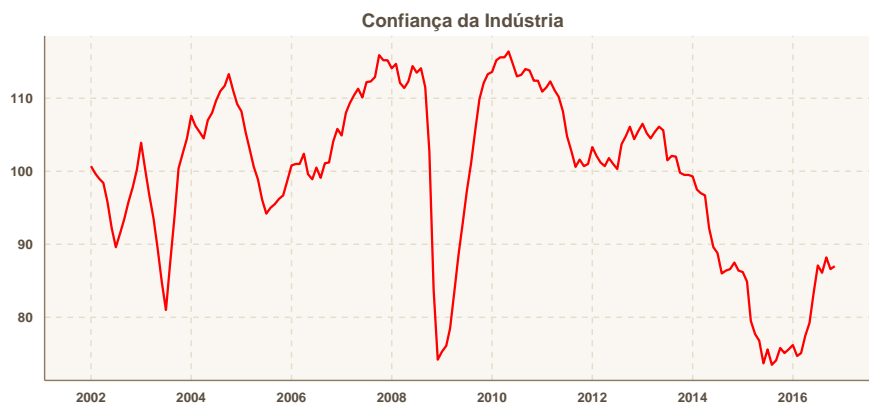
25 de Julho de 2017

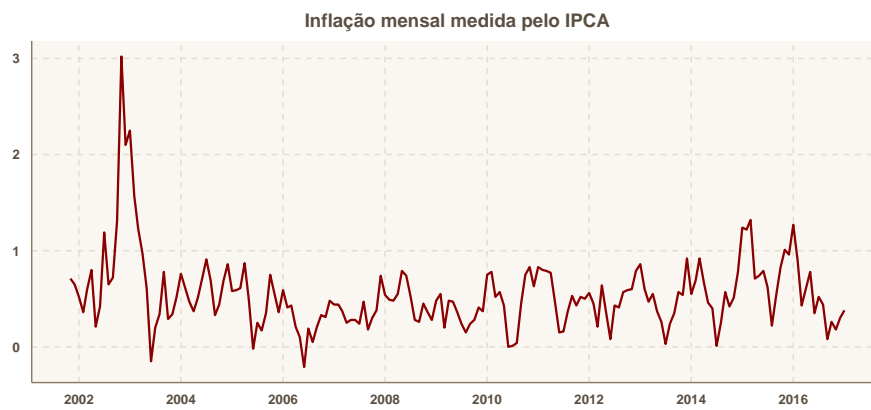
Resumo

Na aula 12 do nosso curso, nós vimos como operacionalizar testes de precedência temporal. Na lista, vamos praticar.

Exercício Sugerido

O `arquivo21.csv` contém quatro séries: a inflação mensal medida pelo IPCA, as expectativas em t para a inflação medida pelo IPCA em $t + 1$, a produção industrial e a confiança da indústria. Abaixo, plotamos os gráficos delas.





Pede-se que

- Você verifique se as séries são estacionárias;
- Verifique se existe precedência temporal entre a inflação mensal medida pelo IPCA e as expectativas de inflação;
- Verifique se existe precedência temporal entre a produção e a confiança industrial.