

Trabalho em dupla (apenas um trio) – 02.10.2008

Use apenas a apostila como referência.

Conversas em voz alta = menos 2 pontos

Perguntas ao professor que podem ser respondidas pela apostila = menos 1 ponto

Outras atividades nos computadores que não o trabalho = menos 10 pontos

Enviar o arquivo com os resultados para claudiods@ibmecmg.br antes de sair da sala.

[30 minutos no máximo] 1. Fazer teste ADF, KPSS, PP para todas as séries designadas a seu grupo.

[20 minutos no máximo] 2. Construa uma tabela com os resultados dos três testes e escreva dois parágrafos sobre a existência ou não de raízes unitárias em suas séries. Não é válido copiar e colar tabelas (ou similares como impressão da tela e cola no documento, o famoso *printscreen*) [máximo 20 linhas]

3. [30 minutos no máximo] A segunda planilha do arquivo contém o índice de confiança do consumidor (ICC). É um índice. Transforme-a em variação mensal. A dica é que ela começa em março de 1999, enquanto todas as séries do exercício 1 são variações percentuais que se iniciam em agosto de 1999, ou seja, não haverá problemas com perdas de observações. Fazer o teste de causalidade de Granger entre suas séries e o ICC.

4. [20 minutos no máximo] Comentar os resultados encontrados em 3. Não copie a tabela do EVIEWS, faça sua tabela no editor de textos, como em 2. Envie o arquivo para o email indicado. [interpretações econômicas que façam sentido serão consideradas como um sinal de algum esforço sincero na matéria. Já o oposto...]

5. [20 minutos no máximo] Todos os grupos debaterão os resultados sob minha coordenação.