

Análise da série temporal do Índice de Atividade Econômica de Minas Gerais (IBCR-MG)

André Rodrigues Corrêa Gomes^{1 4}

Fernando Ribeiro Cassiano^{2 4}

Thelma Sáfyadi^{3 4}

O Índice de Atividade Econômica Regional do Banco Central (IBCR) é um indicador mensal constituído por *proxies* como Agricultura, Indústria de Transformação, Construção Civil, dentre outros. Neste presente trabalho, utilizaremos como base de dados a série mensal do Índice de Atividade Econômica Regional de Minas Gerais (IBCR-MG) no período de janeiro de 2003 a dezembro de 2012. Os dados entre janeiro de 2013 e abril de 2013 foram reservados para fazer a comparação com os valores previstos pelo modelo. O gráfico de média-amplitude mostrou a necessidade de logaritimizarmos os dados. O teste de Cox-Stuart indicou a presença de tendência nesta série temporal. Com o gráfico do periodograma, juntamente com o teste de Fisher pode se demonstrar que a série possui sazonalidade de ordem 12. Utilizando-se da metodologia de Box & Jenkins, construímos um modelo SARIMA para a presente série temporal. Através do valor do Critério de Akaike (AIC = -579,3068) e erro percentual absoluto médio (MAPE=2,11%), concluímos que o modelo SARIMA(2,1,2)X(0,1,1)¹² melhor descreve a série do IBCR-MG.

Palavras-chave: *IBCR-MG, SARIMA,, séries temporais.*

Referências

- [1] BOLETIM REGIONAL DO BANCO CENTRAL – JANEIRO 2009. Disponível em <<http://www.bcb.gov.br/pec/boletimregional/port/2009/01>>. Acesso em 15 jun. 2013.
- [2] MORETTIN, P.A.; TOLOI, C.M.C. Análise de series temporais. 2ª edição, São Paulo: Edgard Blucher, 2006. 531p.
- [3] SGS – SISTEMA GERENCIADOR DE SÉRIES TEMPORAIS. Disponível em <www3.bcb.gov.br/sgspub/localizarseries/>. Acesso em 15 jun. 2013.

¹ DEX - Universidade Federal de Lavras. Email: andrewar82@yahoo.com.br

² DEX - Universidade Federal de Lavras. Email: fernandorc19@yahoo.com.br

³ DEX - Universidade Federal de Lavras. Email: safadi@dex.ufla.br

⁴ Agradecimento à FAPEMIG pelo apoio financeiro.