



H0720

ESTIMANDO A TAXA DE INFLAÇÃO NO BRASIL: COMPARAÇÃO ENTRE O MODELO ARIMA E O MODELO DE REDES NEURAS MULTICAMADAS MLP

Letícia Gavioli (Bolsista PIBIC/CNPq) e Profa. Dra. Ivette Raymunda Luna Huamani (Orientadora), Instituto de Economia - IE, UNICAMP

Desde a adoção, em 1999, do regime de metas para inflação a manutenção das taxas de inflação dentro de metas pré-estabelecidas passou a ser o principal objetivo da política monetária. Por esse motivo e por, principalmente, a inflação causar mudanças nas expectativas, influenciando assim nas decisões reais dos agentes econômicos, torna-se extremamente importante a realização de previsões do IPCA – o índice utilizado como meta oficial da inflação. Com esse objetivo, o modelo de série temporal do tipo ARIMA (Autorregressivo Integrado de Médias Móveis) foi ajustado. Em uma primeira etapa, a série foi analisada e através do teste de raízes unitárias confirmou-se a estacionariedade da série. A identificação do modelo foi realizada através da análise do correlograma da série em nível e de um conjunto de indicadores de adequação como o critério de Schwarz, Akaike e Durbin-Watson. Com base nesses critérios e na análise dos resíduos, obteve-se um modelo AR(1). Finalmente a previsão para conjuntos dentro e fora da amostra foi realizada. As métricas de erro na previsão um passo à frente mostraram um desempenho adequado do modelo, obtendo erros de X e Y em termos de REQM e EAM, respectivamente, para o período fora da amostra.

Previsão - Inflação - ARIMA