

COMPARAÇÃO DA CAPACIDADE DE PREVISÃO DE DIFERENTES MODELOS DE NÚCLEOS DE INFLAÇÃO COM MÉTODOS DE PREVISÃO DE SÉRIES TEMPORAIS.

XXXVIII Encontro de Iniciação Científica

Carlos Henrique Lima da Silva, Luiz Ivan de Melo Castelar

O núcleo da inflação, também denominado de inflação subjacente, é uma medida que procura captar a tendência dos preços, desconsiderando distúrbios resultantes de choques temporários. É uma medida de inflação desenhada para detectar mudanças de caráter fundamental nos preços, que podem ser causadas por pressões de demanda sobre a capacidade produtiva, por choques permanentes nos preços relativos ou por alterações nas expectativas de inflação, tendo por função auxiliar as atividades públicas sendo parâmetro guia para políticas monetárias e fiscais. Existem várias metodologias para o cálculo do núcleo de inflação disponibilizadas pelo banco central do Brasil e, neste trabalho, utiliza-se as séries do IPCA (índice de preços ao consumidor amplo) de núcleo por exclusão, núcleo por médias aparadas, núcleo por médias aparadas suavizadas e núcleo de dupla ponderação, no intuito de estabelecer quais dos modelos utilizados tem melhor capacidade preditiva, se aproximando mais do comportamento da inflação.

O trabalho tem por metodologia o uso do software Eviews 10, para fins de cálculo e observação dos dados da amostra de inflação mensal do período situado entre os anos de 1996 e 2019, com uma janela de previsão para um ano, entre junho de 2018 e junho de 2019, por meio do modelo ARMA (autorregressivos e de médias móveis), e utilizando como medida de análise a raiz do erro quadrático médio para fins de comparação entre os diversos métodos analisados.

Palavras-chave: núcleo. inflação. autoregressivo. médias móveis.