

Uso do EViews para Modelagem GARCH e VAR

1. Preliminares

– Para entrada de dados:

FILE → NEW → WORKFILE

– Especificar a frequência dos dados.

PROCS → IMPORT → READ TEXT-LOTUS-EXCEL

– Para ver a série e gráfico:

VIEW → SHOW → nome da série

QUICK → GRAPH → nome da série

2. Modelagem GARCH

– Para especificar um modelo ARMA + GARCH:

QUICK → ESTIMATE EQUATION

– Por exemplo, um modelo AR(3) + GARCH(1,1) para a variável ibm:

– Na janela ARCH-GARCH:

– Especificar a equação para a média:

ibm c ar(1) ar(2) ar(3)

– Escolher método de estimação: ARCH.

– Escolher tipo de modelo (simétrico),

– ordens do modelo.

– Após estimar o modelo, verificar resíduos:

VIEW → Residual Tests

– Aqui, pedir estatística Q,

– correlação dos quadrados dos resíduos e

- teste ARCH LM.

- Para obter o desvio padrão condicional:

VIEW → Conditional SD

- Na janela ARCH-GARCH há, ainda, possibilidade de
- estimar modelos assimétricos: EGARCH e TARCH.
- Verificar, no manual (ou help) a forma desses modelos.

3. Modelagem VAR

QUICK → ESTIMATE VAR

- Escolha “Unrestricted VAR”
- Especifique as variáveis (endógenas)
- Especifique as variáveis exógenas, se houver.
- Especifique a ordem do modelo; use o SCA antes,
- para determinar a ordem.

4. Causalidade de Granger

QUICK → GROUP STATISTICS → GRANGER CAUSALITY TEST

- Liste as séries.
- Especifique os “lags” (mesma ordem do VAR).