

# Programa e Resumos

XV Congresso Anual  
da Sociedade Portuguesa de Estatística

Lisboa • 19 a 21 de Agosto de 2007



SOCIEDADE PORTUGUESA  
DE ESTATÍSTICA



Instituto Superior de Ciências  
do Trabalho e da Empresa

## Metodologias de previsão baseadas em modelos de índices de difusão – uma aplicação a variáveis da economia Portuguesa

Jorge M. Andraz, *Fac. Economia, Univ. Algarve*, jandraz@ualg.pt

Pedro Gouveia, *ESGHT, Univ. Algarve*, pgouveia@ualg.pt

Paulo M. M. Rodrigues, *Fac. Economia, Univ. Algarve*, prodrig@ualg.pt

**Palavras chave:** índices de difusão, previsão, combinação de previsões, ciclo económico, economia Portuguesa

A metodologia de previsão baseada em índices de difusão proposta por Stock e Watson (1999) permite sintetizar num pequeno conjunto de variáveis (componentes principais) a informação presente num elevado número de variáveis e obter vantagens significativas ao nível da performance de previsão. Com efeito, os ganhos observados ao nível da qualidade da previsão por comparação com modelos tradicionalmente utilizados para fins de previsão, têm determinado um crescente interesse por esta metodologia tanto em termos teóricos como aplicados (vide, inter alia, Stock e Watson, 1999, 2002; Angelini et al., 2001; Marcelino et al. 2002; Shitani, 2004 and Heij et al. 2006).

Neste artigo é utilizado um vasto conjunto de variáveis económicas nacionais e internacionais para efeitos de identificação das componentes principais e de previsão de diversas variáveis da Economia Portuguesa com base no modelo de índices de difusão. Por recurso a uma janela pseudo pós-amostal é avaliada a performance de previsão do modelo proposto por comparação com diversos modelos comumente utilizados no contexto da previsão de variáveis económicas. Este artigo procura ainda ser pioneiro ao nível da incorporação de modelos de índices de difusão no contexto das metodologias de combinação de previsões. Pretende-se deste modo explorar potenciais relações de complementaridade existentes entre o modelo de índices de difusão e diversos modelos econométricos no sentido de uma melhor aproximação ao processo gerador de dados.