



Preços internacionais da Laranja: Propriedades Estatísticas da Série

Diego Matheus Campos¹
Diego Silva Gonçalves²
Tiago Silveira Gontijo³

Centro Universitário Metodista Izabela Hendrix (CEUNIH)

Resumo:

Introdução: Os produtos provenientes da laranja exercem uma grande importância na economia brasileira, o suco não concentrado e não congelado é o principal item de exportação no mercado cítrico. O país representa a expressiva margem de 80% das exportações mundiais da fruta. **Objetivo:** Analisar o comportamento serial dos preços internacionais da laranja. **Metodologia:** A partir de séries temporais pode-se identificar o padrão de comportamento dos preços e fazer previsões para valores futuros, observar erros de previsão variáveis, caracterizando processos heterocedásticos, para capturar tal correlação utilizou-se o modelo autorregressivo de heterocedasticidade condicional (ARCH). Em seguida, um ajuste de modelos da classe GARCH foi realizado a partir da comparação dos indicadores Akaike (AIC), Schwarz (SBC) e Logaritmo de verossimilhança, para obter o modelo que melhor descrevesse a componente de volatilidade da série relativa ao Laranja, onde o modelo GARCH foi o escolhido. **Resultados e Discussão:** A regressão estudada apresentou sinais de autocorrelação serial e heterocedasticidade nos resíduos, ajustou-se um modelo da classe GARCH e foi possível diagnosticar que a série de preços da Laranja é moderadamente estável frente a choques, uma vez que o somatório dos coeficientes ARCH e GARCH foi inferior a 0.8. **Conclusão:** Este artigo, ao reconhecer a importância econômica da Laranja, verificou as propriedades estocásticas da série de preços internacionais, modelos preditivos auxiliarão no desenvolvimento de políticas públicas que objetivam mitigar a incerteza dos agentes econômicos.

Palavras-chave: Preços internacionais da laranja; Propriedades estatísticas da série; Analisar o comportamento serial.

1- Graduando em Engenharia de Produção pelo Centro Universitário Metodista Izabela Hendrix (CEUNIH), diegodiko05@gmail.com

2- Graduando em Engenharia de Produção pelo Centro Universitário Metodista Izabela Hendrix (CEUNIH), diego.sp76@hotmail.com

3- Doutorando em Saúde Pública (UFMG). Mestre em Engenharia de Produção (UFMG), Docente do Centro Universitário Metodista Izabela Hendrix (CEUNIH), tiago.gontijo@izabelahendrix.metodista.br