

Comandos do SPLUS para Modelagem ARIMA

> acf(serie) fornece as autocorrelações da “serie”

> acf(serie, type="partial") fornece as autocorrelações parciais da “serie”

> ts.sim <- arima.sim(list(order=c(1,1,0), ar=0.7), n=200)

Simula 200 valores de um processo ARIMA(1,1,0), com $\phi = 0.7$

> modelo1 <- arima.mle(serie,model=list(order=c(1,0,0), n.cond=3))

Estima um modelo ARIMA(1,0,0) para a “serie”, por MV.

> arima.diag(modelo1, acf.resid=T, gof.lag=10, std.resid=T,plot=T)

diagnóstico do modelo anterior ajustado

> serie.fore <- arima.forecast(serie,n=10,model=modelo1\$model)

Obtém previsões para o modelo ajustado

> serie.diff <- diff(serie, 12) calcula diferenças sazonais para “serie”.

> serie.arima1 <- arima.mle(serie, model=list(list(order=c(2,0,0)),list(order=c(0,1,0), period=12)))

Ajusta um modelo ARIMA sazonal $(2, 0, 0) \times (0, 1, 0)_s$, com $s = 12$ para “série”.

> ar.mod <- arima.mle(serie, model=list(order=c(2,0,0)), ar.opt=c(F,T),

n.cond=2)

Ajusta um modelo AR(2) com $\phi_1 = 0$.

```
> ar.mod <- arima.mle(serie, model=list(order=c(1,0,0)), xreg=x)
```

```
> x <- seq(1,N,1.0)
```

Ajusta um modelo AR(1) com média não nula.