

Lista 2 – Séries temporais

- 1) Observamos séries de tamanho $n=1000$. Como ficam as variâncias da previsão para os tempos 1001, 1002 e 1003 para os seguintes modelos:
 - a) ARIMA(1,0,0)
 - b) ARIMA(0,1,0)
 - c) ARIMA(0,0,1)
 - d) ARIMA(0,1,1)

- 2) Obtenha uma série real de dados mensais para ajustar modelo e fazer previsão.
 - a) Ajuste um modelo ARIMA ou SARIMA para fazer a previsão para um ano. Apresente o modelo ajustado e a análise de resíduos.
 - b) Utilize um método de alisamento exponencial para fazer previsões com intervalos para essa mesma série. Compare os resultados obtidos.

- 3) Já se reúnam em grupo e apresente a análise descritiva da série que vão apresentar em trabalho. Expliquem a fonte dos dados e objetivos da análise.