

## **Lista 03 – Modelos ARMA**

### **1- Através de uma pesquisa na literatura, explique:**

- a) As vantagens para utilização de modelos ARMA
- b) As desvantagens para utilização de modelos ARMA
- c) Principais técnicas de estimação dos parâmetros do modelo

*Referencie cada citação*

**2 - Encontre um modelo ARMA(p,q) que melhor modela a série de chuva (chuva\_fortaleza.xls). Justifique a sua escolha e a utilização de cada procedimento. (Utilize os correlogramas para encontrar os valores de p e q, e o teste ADF e KPSS para verificar estacionariedade)**

**3 – Encontre um modelo ARMA(p,q) que melhor modela a série de mortes por arma de fogo (morte\_armas\_australia.xls) e compare com a estimação por médias móveis e suavização exponencial. (Utilize o gridsearch para encontrar os valores de p e q, e o teste ADF e KPSS para verificar estacionariedade)**

Envie as resoluções junto com o código para os e-mails: [egs@cin.ufpe.br](mailto:egs@cin.ufpe.br) e [psgmn@cin.ufpe.br](mailto:psgmn@cin.ufpe.br)