

Lista 01 – Análise e Previsão de Séries temporais

1- Realize uma análise na série de vendas no varejo no estado de Pernambuco (vendas_varejo_pe). Descreva quais componentes estão na série; se é uma série estacionária; e se existe correlação entre os pontos da série.

2- Encontre um modelo ARMA(p,q) que melhor modela a série de chuva (chuva_fortaleza.xls) e a série de mortes por arma de fogo (morte_armas_australia.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- Aplique a metodologia de Box e Jenkins para realizar a previsão de uma série financeira (à sua escolha). Divida o conjunto de dados em 70% para treinamento (estimação) e 30% teste. Comente cada etapa da metodologia.

Séries: https://github.com/Eraylson/series_temporais

Envie as resoluções junto com o código para o e-mail: egs@cin.ufpe.br