

Séries Temporais

Thiago Tavares Lopes Lucas de Bona Sartor

12 dezembro 2024

Sumário

1 Introdução

1

1 Introdução

O ouro é um ativo financeiro para exportação, investimentos de longo prazo, consumo industrial e câmbio de moedas estrangeiras. Segundo The Gold Bullion Company, o Brasil ocupa o 7º lugar no balanço mundial de oferta e demanda de ouro, com este contexto foi feito uma análise da série histórica do preço de comercialização do ouro entre os anos de 2013 a 2023. O *Dataset* utilizado pode ser acesso neste [link]{<https://www.kaggle.com/code/farzadnekouei/gold-price-prediction-lstm-96-accuracy>}.

A Figura 1, apresenta a série temporal da precificação do ouro para os anos de 2013 até 2023.

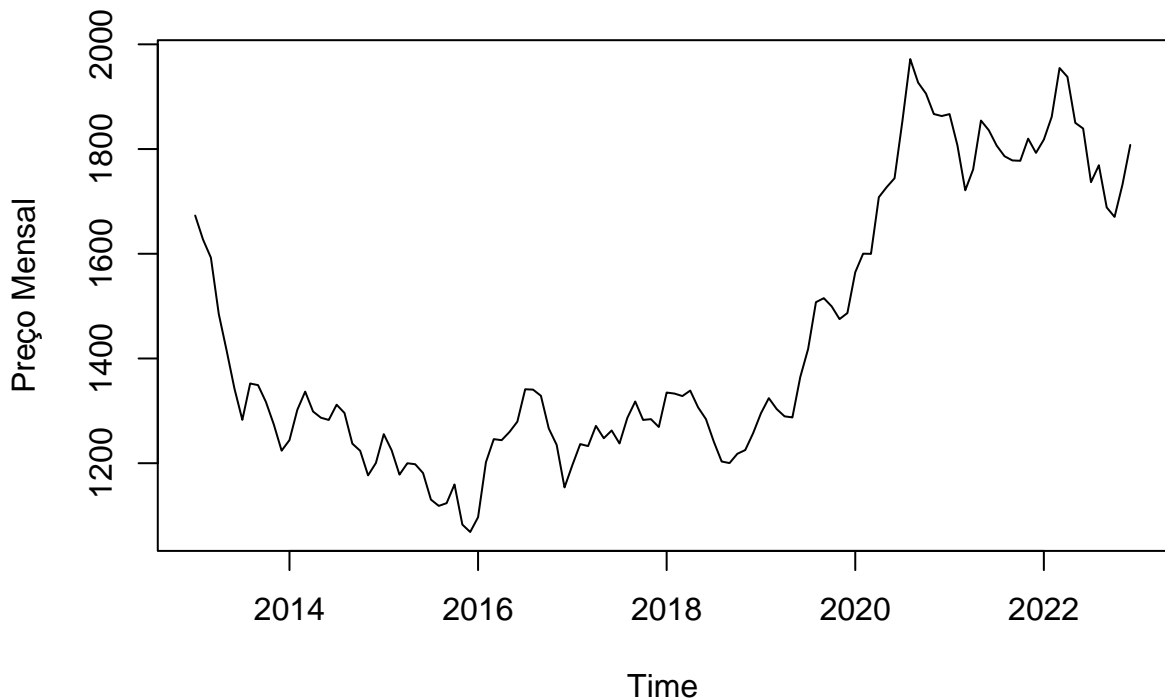


Figura 1: Precificação mensal do Ouro - 2013 à 2023

A Figura 2 apresenta a os resultados de Função de Autocorrelação e a Função de Autocorrelação Parical.

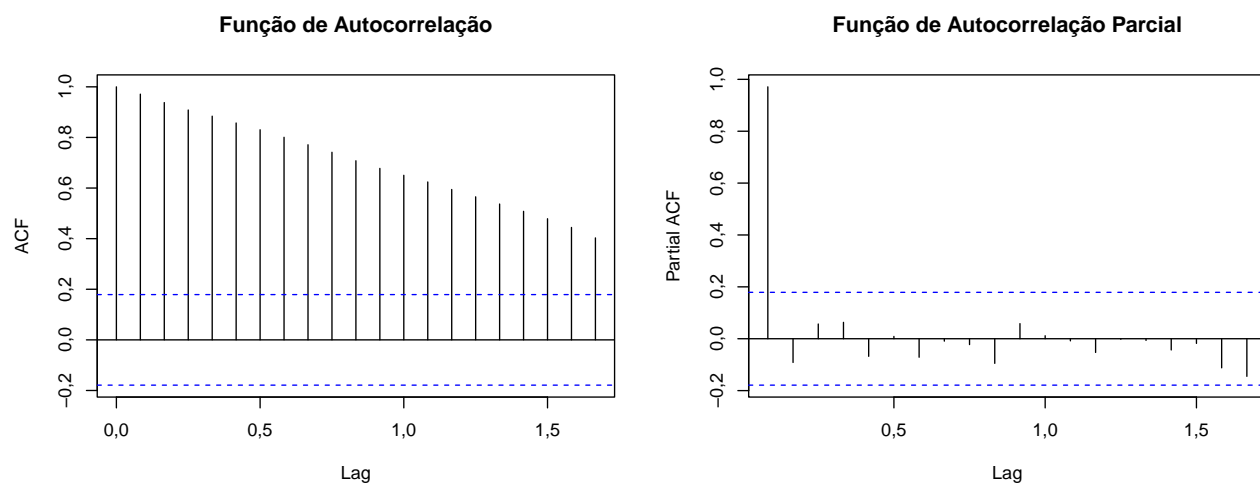


Figura 2: FAC e FACP

Resultados de tendência, raiz unitária e sazonalidade

Resultados Tendência determinística 1

Tabela 1: Teste de Tendência determinística

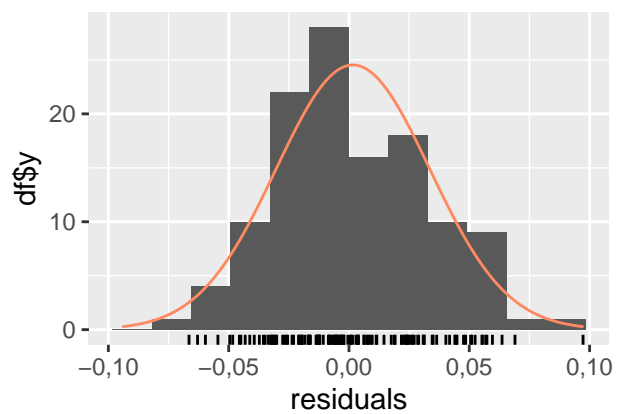
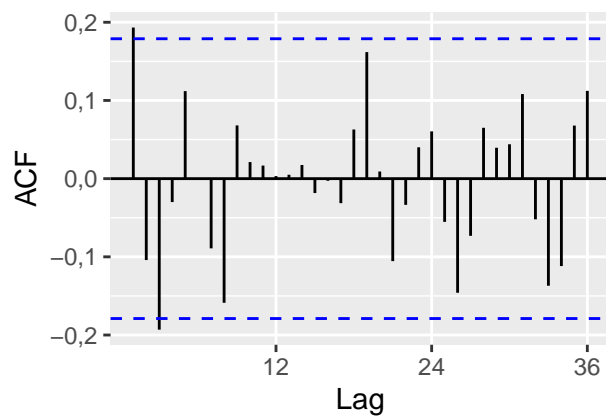
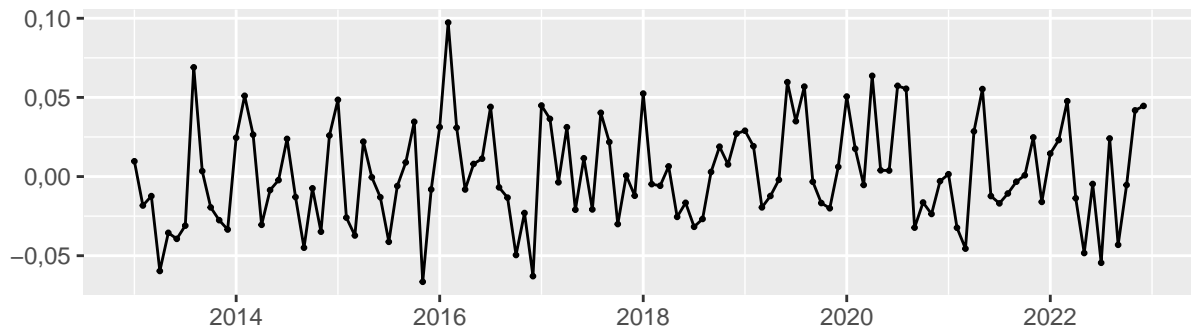
Teste	p-valor	Conclusão
Cox Stuart	0.0	Tendência
Cox Stuart Trend	0.0	Tendência
Mann-Kendall Trend	0.0	Tendência
Mann-Kendall	0.0	Tendência
KPSS Test for Trend	0.0	Tendência

Testes de Raiz unitária

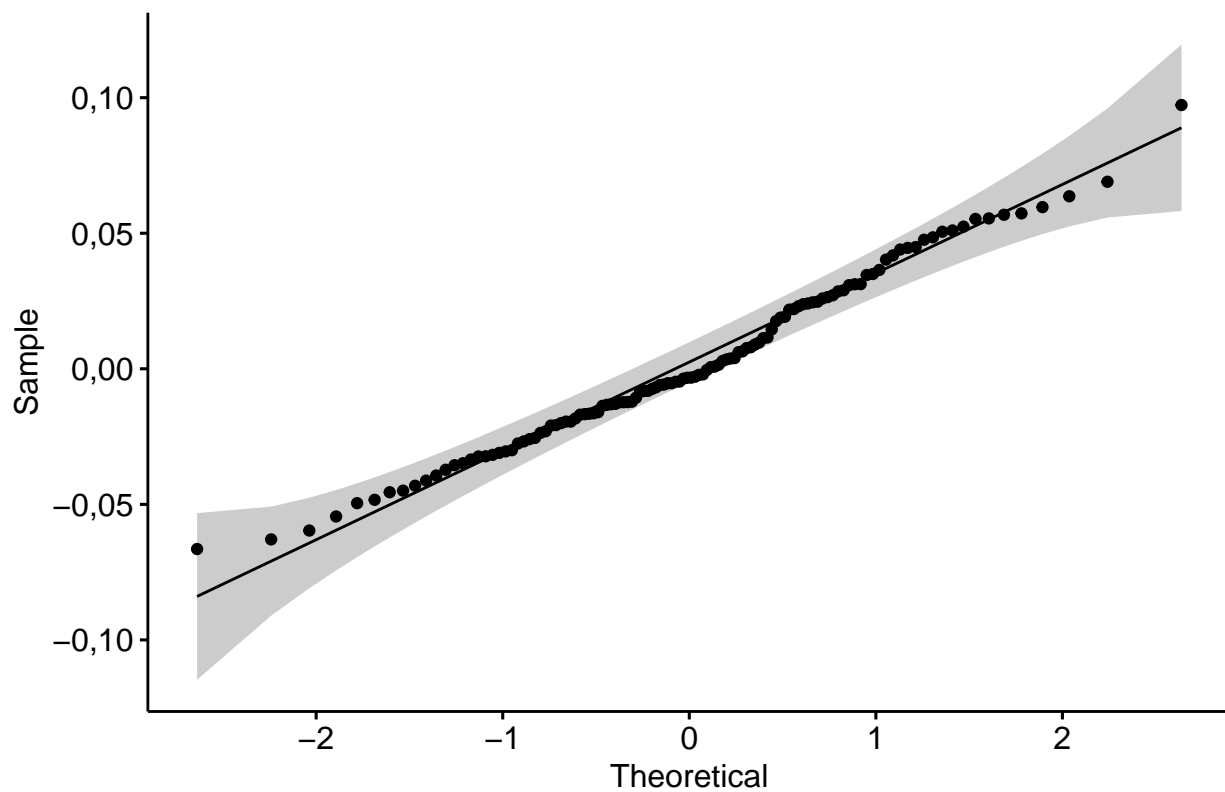
Tabela 2: Teste de Raiz Unitária

Teste	p-valor	Conclusão
Augmented Dickey-Fuller	0.3553	Tendência
Phillips-Perron Unit Root	0.5252	Tendência
KPSS Test for Level	0.0100	Tendência

Residuals from ETS(M,Ad,N)



Resíduos Modelo MAN



```
forecast_ets <- forecast(modelo_ets, h = 12)
plot(forecast_ets)
```

Forecasts from ETS(M,Ad,N)

