

ME607 - Séries Temporais
Primeiro semestre de 2022
Lista de Exercícios II

OBS: Eventualmente pode haver sobreposições do que está sendo pedido em diferentes exercícios (p.e., trata-se da mesma série temporal, demonstrações semelhantes etc). Nesse caso, não é necessário repetir o(s) desenvolvimento(s).

1. Resolva os exercícios deixados em sala de aula.
2. Do livro: Morettin, P. A., Toloí, C. M. C. Toloí (2018). Análise de séries temporais- Volume 1, **terceira edição**, Editora Blucher (disponível no formato digital, veja o programa da disciplina), resolva:
 - a) Capítulo 4: Exercícios - 1, 2, 3, 5, 6, 7, 8, 9, 12.
3. Estude, no Capítulo 4 do livro: Morettin, P. A., Toloí, C. M. C. Toloí (2018), os métodos de suavização que não foram vistos em aula.
4. Considere as Séries temporais (se o que está sendo pedido, para uma dada série temporal, já fora feito em aula, não é necessário repetir), constantes em link (“Conjuntos de Dados (formato texto)” e “Conjunto de Dados (formato excel)”), cujas descrições se encontram no livro mencionado na Questão 2 desta Lista. Resolva os itens abaixo.
 - a) Aplique os testes de Testes de , Box e Pierce e de Ljung-Box, conforme visto em aula, para a ST original bem como para a primeira e segunda diferenças. Apresenta as conclusões apropriadas.