

ME607 - Séries Temporais  
Primeiro semestre de 2024  
Lista de Exercícios III

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 5: Exercícios - 1, 2, 3, 4, 5, 9, 15, 17, 19, 21, 35, 42.
3. Do livro: Pérez, F. L. (2021). Análise de Séries Temporais, [link](#). (última atualização, 19/10/2023), resolva:
  - a) Capítulo III. Modelos ARIMA: Exercícios: 1, 2- item h) e 5.
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. Analise-as de forma exploratória e ajuste pelo menos um modelo  $AR(p)$  para a série original, ou a sua primeira diferença ou a sua segunda diferença, conforme visto em sala. Ou seja, se a ST original for estacionária, considere somente ela. Caso contrário, se a primeira diferença for estacionária, considere-a, se não o for, considere a segunda.
5. Considere as Séries Temporais (se o que está sendo pedido, para uma dada série temporal, já fora feito em aula, não é necessário repetir), vistas durante as aulas. Analise-as de forma exploratória e ajuste pelo menos um modelo  $AR(p)$  para a série original, ou a sua primeira diferença ou a sua segunda diferença, conforme visto em sala. Ou seja, se a ST original for estacionária, considere somente ela. Caso contrário, se a primeira diferença for estacionária, considere-a, se não o for, considere a segunda.