

Testes de resíduos

- Significância individual: aproximações sujeitas à erro considerável;
- Significância conjunta (Ljung-Box): livre de aproximações
- Mais peso à maior confiabilidade: Ljung-Box

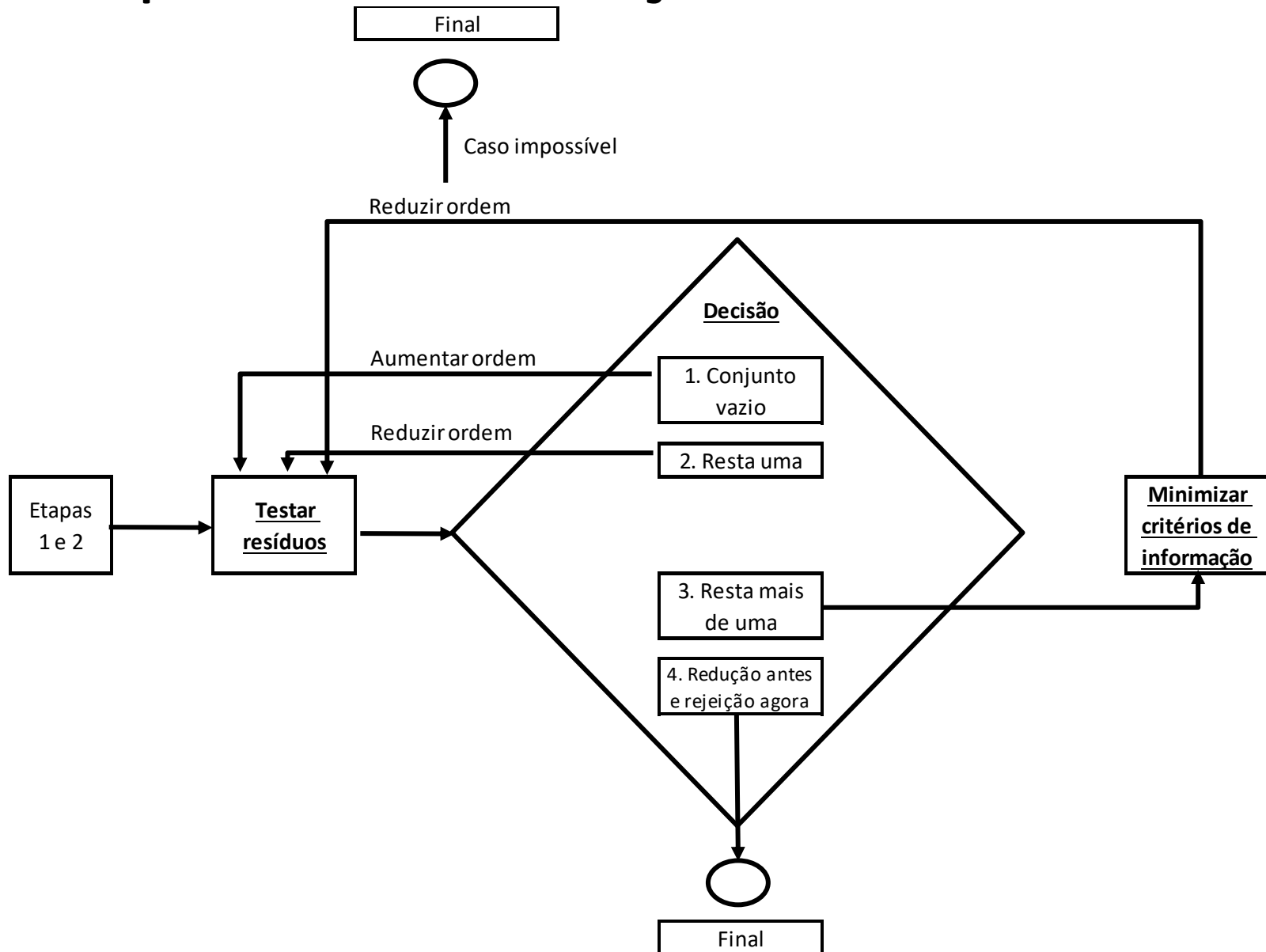
Critérios de decisão

Geral =	Erro de previsão	+	Perda de graus de liberdade
AIC =	T.log(SQR)	+	2.(K+1)
BIC =			Log(T).(K+1)
HQ =			2.(K+1).log(log(T))

Critérios de decisão

Objetivo: **minimizar** os critérios

Etapas 3 e 4: iteração: teste $\leftrightarrow$ decisão



Previsão com ARMA

Convergência da previsão para a média da série

- AR(1): $E[y_{t+h} | I_t] = c/(1 - \varphi) + \varphi^j y_t$
- MA(1): $\begin{cases} E[y_{t+h} | I_t] = c, & \text{se } h = 1 \\ 0, & \text{c.c.} \end{cases}$