

Preço de Venda do Suco de Laranja no Brasil: uma análise através de modelos ARIMA

Donizete Almeida (BIC-UCS), Maria Emilia Camargo (orientadora) –
dony.almeida@gmail.com

Séries temporais, de uma forma em geral, podem ser consideradas como realizações de processos estocásticos ao longo do tempo. O objetivo deste trabalho foi estudar os modelos de séries temporais e aplicar aos dados de preço de venda do suco de laranja no Brasil no período de janeiro de 2000 a dezembro de 2008. O método de pesquisa científica do ponto de vista da natureza e da forma de abordagem do problema proposto neste trabalho enquadra-se, de acordo com Silva & Menezes (2001), na categoria de pesquisa aplicada quantitativa. A pesquisa aplicada quantitativa tem como objetivo gerar conhecimentos para aplicação prática dirigida à solução de problemas específicos com o uso de recursos e técnicas estatísticas, bem como de caráter exploratório, que segundo Tripodi et al. (1975), o estudo exploratório tem por objetivo “fornecer um quadro de referência que possa facilitar o processo de dedução de questões pertinentes na investigação de um fenômeno”. Após várias verificações de ajuste indicadas pelas funções de auto-correlação e auto-correlação parcial, gráficos de resíduos e verificações das pressuposições básicas para o ajuste bem como uma análise do diagnóstico, o modelo que melhor se ajustou e explicou o comportamento da série em estudo foi um ARIMA (1,01). Também foram testados outros modelos com diferentes parâmetros, os quais apresentaram problemas para a obtenção dos estimadores. Com o modelo encontrado foram realizadas para o período de 12 meses.

Palavras-chave: séries temporais, modelos ARIMA, preços.

Apoio: UCS.

XVII Encontro de Jovens Pesquisadores - Setembro de 2009
Pró-Reitoria de Pós-Graduação e Pesquisa
Universidade de Caxias do Sul