

ANÁLISE TEMPORAL DA PRODUÇÃO NACIONAL DE VEÍCULOS COMERCIAIS LEVES

Juliano Bortolini^{1,2}, Wederson Leandro Ferreira^{1,2},
Gilberto Rodrigues Liska^{1,2}, Tábata Saturnina Trindade de Moraes^{1,2},
Renato Ribeiro de Lima^{1,2}

RESUMO

Este trabalho tem o intuito de analisar o comportamento da série produção nacional de veículos comerciais leves, utilizando análise de séries temporais. Para a análise, foram considerados os modelos de séries temporais sem e com a presença de intervenção, visto que a época de estudo contempla a época da crise econômica 2008. Os dados são mensais, compreendendo o período de janeiro de 1960 a fevereiro de 2012, totalizando 626 observações. A transformação logarítmica foi considerada para a estabilização da variância. A qualidade dos ajustes foi verificada através do teste de Ljung-Box. Os modelos ajustados foram comparados através do critério de informação de Akaike (AIC) e indicou-se aquele que forneceu o menor valor. O modelo mais bem ajustado apresentou componentes de tendência e sazonalidade de período 12, sendo ele o SARIMA(1,1,2)(1,0,2)₁₂ CI, com intervenção do tipo abrupta e temporária na observação 587.

Palavras-chave: *Séries temporais, Análise de intervenção, Modelo SARIMA, Produção de veículos.*

¹Estatística e Experimentação Agropecuária - UFLA, bortolini@posgrad.ufla.br, wedelean@hotmail.com, gilbertoliska@hotmail.com, tabata1805@gmail.com, rrlima@dex.ufla.br

²Agradecimento à FAPEMIG pelo apoio financeiro.