

Per la serie storica a voi intestata dovete realizzare:

- 1) Imputazione dei valori mancanti**
- 2) Trattamento delle anomalie**
- 3) Analisi grafica della serie**
- 4) Presenza di trend e di stagionalità**
- 5) Analisi delle autocorrelazioni**
- 6) Scelta del miglior modello dopo aver considerato:**
 - a) Identificazione automatica BF**
 - b) Identificazione automatica Built-in**
 - c) Identificazione automatica di un AR puro**
 - d) Identificazione automatica BF e Built-in per i residui di un polinomio additivo**
 - e) Procedura prove ed errori ragionata**

Lasciate fuori dalla stima le ultime 12 osservazioni ed usatele come benchmark per i diversi modelli. Una volta individuato il miglior modello, applicatene la procedura alla serie intera e verificate la conferma del modello.

Commentate e documentare tutte le decisioni prese e discutete l'impatto di tali scelte sulle previsioni che avete realizzato.

L'esame consisterà nella discussione della relazione d'analisi della serie storica unitamente alla dispensa del corso.

La relazione deve pervenire in PDF alla mail agotar@unical.it entro le 21:00 del 24.02.10 se si intende sostenere l'appello del 26.02.10 ovvero entro le 21:00 dello 03.03.10 se si intende sostenere l'appello dello 05.03.10

In mancanza della relazione il voto di profitto non potrà superare il livello di 18/30.