

# Previsão da Série de Preços Globais de Metanol Através dos Modelos BOX & JENKINS e Regressão Dinâmica

Alunos: Juliana dos Santos Lopes e Lucas de Barros Pimenta

Orientador: Prof. Reinaldo Castro Souza

Co-orientador: Prof. Fernando Luiz Cyrino Oliveira

## RESUMO

A previsão auxilia na tomada de decisões dos agentes envolvidos em atividades que necessitam de planejamento e redução de incertezas. A redução de incertezas é especialmente importante no mercado de commodities, como é o caso do metanol, pois sendo este um mercado global, está muito sujeito às variações de mercado. Este trabalho tem como proposta determinar um modelo consistente para a previsão de preços de metanol, através da utilização dos modelos Box & Jenkins e Regressão Dinâmica. Estes dois modelos são então comparados através de seus indicadores e o que apresenta melhores resultados é utilizado para a previsão de 12 meses do preço do metanol. Esta previsão é, então, comparada com os valores reais ocorridos no ano de 2010.

*Palavras-chave: Previsão. Regressão Dinâmica. Box & Jenkins. Metanol.*