Programa Analítico de Disciplina

EST 437 - Séries Temporais

Departamento de Estatística - Centro de Ciências Exatas e Tecnológicas
Catálogo: 2019
Número de créditos: 3 Carga horária semestral: 45h Carga horária semanal teórica: 3h Carga horária semanal prática: 0h Semestres: I

Objetivos
Fornecer base teórica para a modelagem de séries temporais.

Ementa
Preliminares. Modelos lineares estacionários e não-estacionários. Construção de modelos estocásticos.

Pré e co-requisitos
EST 105 e (MAT 135 ou MAT 137) e (MAT 143 ou MAT 147)

Oferecimentos obrigatórios
Não definidos

Oferecimentos optativos

Curso	**Grupo de optativas**
Licenciatura em Matemática	Geral
Matemática - Bacharelado	Grupo B2
Matemática - Licenciatura (Integral)	Geral

A autenticidade deste documento pode ser conferida no site https://siadoc.ufv.br/validar-documento com o código: YMK2.LLGA.DHJ6

EST 437 - Séries Temporais

Conteúdo					
Unidade	**T**	**P**	**ED**	**Pj**	**To**
1. **Preliminares** 1. Espaços de probabilidade 2. Séries temporais 3. Funções e series temporais periódicas 4. Processos estocásticos 5. Estacionariedade forte e fraca 6. Funções de auto-covariância e auto-correlação e suas estimações	18h	0h	0h	0h	18h
2. **Modelos lineares estacionários e não-estacionários** 1. Modelos lineares estacionários 2. Processos auto-regressivos de médias móveis e mistas 3. Estacionariedade e invertibilidade 4. Modelos lineares não-estacionários 5. Processos de médias móveis e auto-regressivo integrado 6. Processo de médias móveis integrado	18h	0h	0h	0h	18h
3. **Construção de modelos estocásticos** 1. Especificação 2. Identificação 3. Estimação e previsão	9h	0h	0h	0h	9h
Total	**45h**	**0h**	**0h**	**0h**	**45h**

(T)Teórica; (P)Prática; (ED)Estudo Dirigido; (Pj)Projeto; Total(To)

Planejamento pedagógico	
Carga horária	**Itens**
Teórica	Apresentação de conteúdo oral e escrito com o apoio de equipamento (projetor, quadro-digital, TV, outros); e Apresentação de conteúdo oral e escrito em quadro convencional
Prática	*Não definidos*
Estudo Dirigido	*Não definidos*
Projeto	*Não definidos*
Recursos auxiliares	*Não definidos*

A autenticidade deste documento pode ser conferida no site https://siadoc.ufv.br/validar-documento com o código: YMK2.LLGA.DHJ6

EST 437 - Séries Temporais

Bibliografias básicas
Não definidas

Bibliografias complementares	
Descrição	**Exemplares**
ANDERSON, T.W. The statistical analysis of time series. New York: John Wiley, 1971.	2
BOX, George E. P; JENKINS, Gwilym M; REINSEL, Gregory C. Time series analysis: forecasting and control. 3.ed. Englewood Clãfs, N.J.: Prentice Hall, c1994. xvi, 598 p. ISBN 0130607746.	1
FULLER, Wayne A. Introduction to statistical time series. New York: J. Wiley, 1976 470p.	1

A autenticidade deste documento pode ser conferida no site https://siadoc.ufv.br/validar-documento com o código: YMK2.LLGA.DHJ6