



UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA

ESTE DOCUMENTO NÃO SUBSTITUI O ORIGINAL

Programa Analítico de Disciplina

EST437 Séries Temporais

Departamento de Estatística - Centro de Ciências Exatas e Tecnológicas

Número de créditos: 3		<u>Teóricas</u>	<u>Práticas</u>	<u>Total</u>
Duração em semanas: 15	Carga horária semanal	3	0	3
Períodos - oferecimento: I	Carga horária total	45	0	45

Pré-requisitos (Pré ou co-requisitos)*

EST105 e (MAT135 ou MAT137) e (MAT143 ou MAT147)

Ementa

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

Oferecimento aos Cursos

Curso	Modalidade	Período
Matemática(BAC)	Optativa	-
Matemática(LIC)	Optativa	-



UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA

ESTE DOCUMENTO NÃO SUBSTITUI O ORIGINAL

EST437 Séries Temporais

Seq	Aulas Teóricas	Horas/Aula
1	Preliminares 1.1. Espaços de probabilidade 1.2. Séries temporais 1.3. Funções e series temporais periódicas 1.4. Processos estocásticos 1.5. Estacionariedade forte e fraca 1.6. Funções de auto-covariância e auto-correlação e suas estimações	18
2	Modelos lineares estacionários e não-estacionários 2.1. Modelos lineares estacionários 2.2. Processos auto-regressivos de médias móveis e mistas 2.3. Estacionariedade e invertibilidade 2.4. Modelos lineares não-estacionários 2.5. Processos de médias móveis e auto-regressivo integrado 2.6. Processo de médias móveis integrado	18
3	Construção de modelos estocásticos 3.1. Especificação 3.2. Identificação 3.3. Estimção e previsão	9



UNIVERSIDADE FEDERAL DE VIÇOSA

ESTE DOCUMENTO NÃO SUBSTITUI O ORIGINAL

EST437 Séries Temporais

Referências Bibliográficas

Bibliografia Básica:

Bibliografia Complementar:

- 1 - ANDERSON, T.W. The statistical analysis of time series. New York: John Wiley, 1971. [Exemplares disponíveis: Não informado.]
- 2 - BOX, G.E.P. and JENKINS, G.M. Time series analysis forecasting and central. São Francisco: Holden Day, 1970. [Exemplares disponíveis: Não informado.]
- 3 - FULLER, W.A. Introduction to statistical time series. New York: John Wiley, 1976. [Exemplares disponíveis: Não informado.]