



Estrutura Curricular (EC)

FORMULÁRIO Nº 13 – ESPECIFICAÇÃO DA DISCIPLINA		
CONTEÚDOS DE ESTUDOS		CÓDIGO
Estatística		0217-8
NOME DA DISCIPLINA	CÓDIGO	criação (X)
Análise de Séries Temporais	GET00071	ALTERAÇÃO: NOME () CH ()
DEPARTAMENTO DE EXECUÇÃO: Estatística (GET)		
CARGA HORÁRIA TOTAL: 80	TEÓRICA: 60	PRÁTICA: 20 ESTÁGIO:
DISCIPLINA: OBRIGATORIA (X) OPTATIVA ()		
OBJETIVOS DA DISCIPLINA: Apresentar as técnicas mais utilizadas em análise de séries temporais com ênfase na parte teórica dos modelos e suas aplicações.		
DESCRIÇÃO DA EMENTA: Decomposição de uma série. Médias móveis. Alisamento exponencial. Processos estacionários. Modelos ARMA e ARIMA. Identificação e estimação. Séries sazonais aditivas e multiplicativas. Funções de transferência.		
BIBLIOGRAFIA BÁSICA: <ol style="list-style-type: none">1. Morettin, Pedro Alberto; Toloi, Clélia M. C. Análise de séries temporais. Edgard Blucher, 2006.2. Tiao, George C.; Pena, Daniel; Tsay, Ruel S. A. A Course in Time series analysis. Wiley, 2011.3. Chatfield, C. The analysis of time series: an introduction. Chapman&Hall/CRC, 2003.		
BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR: <ol style="list-style-type: none">1. Zellner, Arnold. Statistics, Econometrics and Forecasting. Cambridge Univ. Press, 2004.2. Anderson, T. W. The Statistical of Time Series. Wiley, 1971.3. Wei, William W. Time series analysis: univariate and multivariate methods. Addison-Wesley, 2005.4. Brockwell, Peter J.; Davis, Richard A. Introduction to time series and forecasting. Springer-Verlag, 2003.		

COORDENADOR

CHEFE DE DEPTO

DATA ____/____/____

DATA ____/____/____