

*Estrutura Curricular (EC)*

FORMULÁRIO Nº 13 – ESPECIFICAÇÃO DA DISCIPLINA/ATIVIDADE		
CONTEÚDO DE ESTUDOS Estatística		
NOME DA DISCIPLINA/ATIVIDADE Análise de Séries Temporais I	CÓDIGO GET00127	CRIAÇÃO () ALTERAÇÃO: NOME () CH ()
DEPARTAMENTO/COORDENAÇÃO DE EXECUÇÃO: GET – Departamento de Estatística		
CARGA HORÁRIA TOTAL: 102H	TEÓRICA: 68H	PRÁTICA: 34H ESTÁGIO:
DISCIPLINA/ATIVIDADE: OBRIGATORIA (X)	OPTATIVA ()	AC ()
OBJETIVOS DA DISCIPLINA/ATIVIDADE: Apresentar as técnicas mais utilizadas em análise de séries temporais com ênfase na parte teórica dos modelos e suas aplicações.		
DESCRIÇÃO DA EMENTA: Decomposição clássica da série temporal. Métodos de suavização exponencial. Modelos ARIMA e SARIMA.		
BIBLIOGRAFIA BÁSICA: 1. CHATFIELD, Chris. The Analysis of time series: an introduction . 6ª ed. Boca Raton: Chapman and Hall, c2004. 333p (Texts Statistical Science) ISBN 1-58488-317-0. 2. MORETTIN, Pedro Alberto,; TOLOI, Clélia M. C. Análise de séries temporais . São Paulo: Blucher, 2006. 538p. 3. WEI, William W. S. Time series analysis: univariate and multivariate methods . 2nd. ed. La Salle: Pearson Education, Inc., c2006. 614p ISBN 0-321-32216-9.		
BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR: 1. ANDERSON, T. W. The statistical analysis of time series . New York: Wiley Interscience, 1994. 704p (Wiley Classics Library) ISBN 0-471-04745-7. 2. PEÑA, Daniel; TIAO, George C.; TSAY, Ruey S. A Course in Time Series Analysis . New York: John Wiley & Sons, c2001. 460p (Wiley Series in Probability and Statistics. Probability and statistics section) ISBN 0-471-36164-X. 3. BROCKWELL, Peter J.; DAVIS, Richard A. Introduction to time series and forecasting . 2nd. ed. New York: Springer-Verlag, c2002. 434p (Springer texts in statistics) ISBN 0-387-95351-5.		

COORDENADOR

DATA ____/____/____

CHEFE DE DEPARTAMENTO

DATA ____/____/____