

Relatório de Conteúdo Programático

Grau: Graduação Presencial

Órgão: GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

Nome: MODELOS BAYESIANOS DE PREVISÃO

Código: GET00228

Característica: CO - Comum

Status: Ativa

Carga Horaria Total: 60h

Estagio: 0h

Teorica: 44h

Pratica: 16h

Extensão: 0h

Período de vigência: 1º período de 2023 até a presente data.

Conteúdo Programático:

1. INTRODUÇÃO AOS MODELOS DINÂMICOS
 - A. REVISÃO DE INFERÊNCIA BAYESIANA.
 - B. INFERÊNCIA NO MODELO DE REGRESSÃO.
 - C. DEFINIÇÕES BÁSICAS E NOTAÇÃO.
 - D. MODELO LINEAR DINÂMICO CONSTANTE.
 - E. INTERVENÇÃO.
2. MODELO LINEAR DINÂMICO
 - A. INTRODUÇÃO.
 - B. MODELO DE ESPAÇO DE ESTADOS.
 - C. EQUAÇÕES DE OBSERVAÇÃO E ATUALIZAÇÃO.
 - D. PREVISÃO.
 - E. EXEMPLO.
 - F. VARIÂNCIA OBSERVACIONAL DESCONHECIDA.
3. MODELO LINEAR DINÂMICO GERAL
 - A. INTRODUÇÃO.
 - B. MODELO DE REGRESSÃO DINÂMICA.
 - C. MODELO UNIVARIADO GERAL $\{F_T, G_T, V_T, W_T\}$
 - D. MODELOS DINÂMICOS APLICADOS À SÉRIES TEMPORAIS.
 - E. MODELOS DE TENDÊNCIA E SAZONALIDADE.
 - F. EXEMPLOS

Ementa:

MODELO LINEAR DINÂMICO. MODELO POLINOMIAL DE PRIMEIRA ORDEM. MODELO LINEAR DINÂMICO GERAL. MODELOS DE TENDÊNCIA E SAZONALIDADE. MODELO DE REGRESSÃO DINÂMICA.

Bibliografia Básica:

1. WEST, MIKE; HARRISON, JEFF. BAYESIAN FORECASTING AND DYNAMIC MODELS. 2ND ED. NEW YORK: SPRINGER-VERLAG, C1997.680P (SPRINGER SERIES IN STATISTICS) ISBN 038794725-6.
2. POLE, ANDY; WEST, MIKE; HARRISON, JEFF. APPLIED BAYESIAN FORECASTING AND TIME SERIES ANALYSIS. NEW YORK: CHAPMAN AND HALL, C1994. XVIII, 409P (TEXTS IN STATISTICAL SCIENCE) ISBN 0-412-04401-3.

Bibliografia Complementar:

Gerado em: 25/10/2023 - 00:08

Este documento foi gerado pelo Sistema Acadêmico da Universidade Federal Fluminense - IdUFF.
Este documento pode ter sua autenticidade validada em até 1 (um) ano a partir de sua emissão no endereço
<https://app.uff.br/iduff>, no link da seção "Validar Declaração".

Relatório de Conteúdo Programático

1. MIGON, HÉLIO DOS SANTOS; GAMERMAN, DANI; RODRIGUEZ, ROMY. INTRODUÇÃO AOS MODELOS DINÂMICOS. DISPONÍVEL EM [HTTP://WWW.DIN.UEM.BR/SBPO/SBPO2004/PDF/ARQ0278.PDF]

2. EHLERS, RICARDO. ANÁLISE DE SÉRIES TEMPORAIS. DISPONÍVEL EM HTTP://CONTEUDO.ICMC.USP.

Gerado em: 25/10/2023 - 00:08

Este documento foi gerado pelo Sistema Acadêmico da Universidade Federal Fluminense - IdUFF.
Este documento pode ter sua autenticidade validada em até 1 (um) ano a partir de sua emissão no endereço
<https://app.uff.br/iduff>, no link da seção "Validar Declaração".