

Relatório de Conteúdo Programático

Grau: Graduação Presencial

Órgão: GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

Nome: ANÁLISE DE SÉRIES TEMPORAIS

Código: GET00201

Característica: CO - Comum

Status: Ativa

Carga Horaria Total: 90h

Estagio: 0h

Teorica: 60h

Pratica: 30h

Extensão: 0h

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

Conteúdo Programático:

1. PROCESSOS ESTOCÁSTICOS & SÉRIES TEMPORAIS
 - A. MOTIVAÇÃO PRÁTICA
 - B. DEFINIÇÕES DE PROCESSO ESTOCÁSTICO E DE SÉRIE TEMPORAL
 - C. EXEMPLOS
2. ESTACIONARIEDADE
 - A. MOTIVAÇÃO
 - B. DEFINIÇÕES DE ESTACIONARIEDADE
 - C. EXEMPLOS
 - D. DEFINIÇÃO DE FUNÇÃO DE AUTO-COVARIÂNCIA (FACV) E DE FUNÇÃO DE AUTO-CORRELAÇÃO (FAC).
3. PREVISÃO
 - A. DELIMITAÇÃO DO PROBLEMA DE PREVISÃO: OBTENÇÃO DE PREVISÃO PONTUAL E MEDIDAS DE INCERTEZA
 - B. FUNÇÃO DE PREVISÃO ÓTIMA GLOBAL: ESPERANÇA CONDICIONAL
 - C. EXEMPLOS
 - D. FUNÇÃO DE PREVISÃO ÓTIMA LINEAR: ESTIMADOR LINEAR ÓTIMO
 - E. EXEMPLOS
4. PREVISÃO
 - A. DELIMITAÇÃO DO PROBLEMA DE PREVISÃO: OBTENÇÃO DE PREVISÃO PONTUAL E MEDIDAS DE INCERTEZA
 - B. FUNÇÃO DE PREVISÃO ÓTIMA GLOBAL: ESPERANÇA CONDICIONAL
 - C. EXEMPLOS
 - D. FUNÇÃO DE PREVISÃO ÓTIMA LINEAR: ESTIMADOR LINEAR ÓTIMO
 - E. EXEMPLOS
5. MODELOS PARA SÉRIES TEMPORAIS
 - A. MODELO AR
 - B. MODELO MA
 - C. MODELO ARMA
 - D. SÉRIE INTEGRADA
 - E. MODELO ARIMA
 - F. METODOLOGIA DE BOX-JENKINS
6. IDENTIFICAÇÃO DE MODELOS ARIMA
 - A. PROCEDIMENTOS DE IDENTIFICAÇÃO
 - B. FUNÇÃO DE AUTO-CORRELAÇÃO (FAC)
 - C. FUNÇÃO DE AUTO-CORRELAÇÃO PARCIAL (FACP)

Gerado em: 24/10/2023 - 23:55

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/duff>, no link da seção "Validar Declaração".

Relatório de Conteúdo Programático

- 7. ESTIMAÇÃO, DIAGNÓSTICO E PREVISÃO DE MODELOS ARIMA
- 8. DECOMPOSIÇÃO DE UMA SÉRIE TEMPORAL
 - A. DEFINIÇÃO DE TENDÊNCIA, FATORES SAZONAL E EFEITO ALEATÓRIO
 - B. TENDÊNCIAS
 - I. MÉTODO DAS MÉDIAS MÓVEIS
 - II. MÉTODO DE HOLT
 - C. SAZONALIDADE
 - I. MÉTODO DAS MÉDIAS MÓVEIS
 - II. MÉTODO DA REGRESSÃO
 - III. MÉTODO DE HOLT-WINTERS

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.

Gerado em: 24/10/2023 - 23:55

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".