

Relatório de Conteúdo Programático

Grau: Graduação Presencial

Órgão: GET - DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

Nome: ANÁLISE DE SÉRIES TEMPORAIS I

Código: GET00127

Característica: CO - Comum

Status: Ativa

Carga Horaria Total: 102h

Estagio: 0h

Teorica: 68h

Pratica: 34h

Extensão: 0h

Período de vigência: 1º período de 2012 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 AUTOCORRELAÇÃO (FAC)
 - C. FUNÇÃO DE AUTOCORRELAÇÃO PARCIAL (FACP)
7. ESTIMAÇÃO, DIAGNÓSTICO E PREVISÃO DE MODELOS ARIMA
8. DECOMPOSIÇÃO DE UMA SÉRIE TEMPORAL
 - A. DEFINIÇÃO DE TENDÊNCIA, FATORES SAZONAIS E EFEITO ALEATÓRIO
 - B. TENDÊNCIAS
 - I. MÉTODOS DAS MÉDIAS MÓVEIS

Gerado em: 09/04/2025 - 10:28

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

II. MÉTODODEHOLT
C. SAZONALIDADE
I. MÉTODODASMÉDIASMÓVEIS
II. MÉTODODAREGRESSÃO
III. MÉTODODEHOLT-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. 6ªed. 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: 09/04/2025 - 10:28

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".