

## 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 2025 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 DE PRIMEIRA ORDEM.
  - E. INTERVENÇÃO.
2. MODELO LINEAR DINÂMICO
  - A. INTRODUÇÃO.
  - B. MODELO DE ESPAÇO DE ESTADOS.
  - C. EQUAÇÕES DE OBSERVAÇÃO E ATUALIZAÇÃO.
  - D. PREVISÃO.
  - E. FATOR DE DESCONTO.
  - F. VARIÂNCIA OBSERVACIONAL DESCONHECIDA.
3. MODELO LINEAR DINÂMICO GERAL
  - A. INTRODUÇÃO.
  - B. MODELO DE REGRESSÃO DINÂMICA.
  - C. MODELO UNIVARIADO GERAL  $\{F_T, G_T, V_T, W_T\}$
  - E. MODELOS DE TENDÊNCIA E SAZONALIDADE.
  - F. PREVISÃO.

### 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, M., E HARRISON, J. BAYESIAN FORECASTING AND DYNAMIC MODELS (2ND ED.). NEW YORK: SPRINGER-VERLAG, 1997. (SPRINGER SERIES IN STATISTICS). ISBN 038794725-6.
- [2] POLE, A., WEST, M., E HARRISON, J. APPLIED BAYESIAN FORECASTING AND TIME SERIES ANALYSIS. NEW YORK: CHAPMAN AND HALL, 1994. (TEXTS IN STATISTICAL SCIENCE). ISBN 0-412-04401-3.

### Bibliografia Complementar:

- [1] PRADO, RAQUEL; FERREIRA, MARCO A. R.; E WEST, MIKE. TIME SERIES: MODELING, COMPUTATION, AND INFERENCE, SECOND EDITION (2ND ED.). CHAPMAN AND HALL/CRC, 2021. ISBN 978-1032040042.

Gerado em: 10/04/2025 - 09:51

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

[2] PETRIS, GIOVANNI; PETRONE, SONIA; E CAMPAGNOLI, PATRIZIA. DYNAMIC LINEAR MODELS WITH R (USE R!). SPRINGER, 2009. ISBN 978-0387772370.

Gerado em: 10/04/2025 - 09:51

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".

**REL250410095124539**

**91F1.B9EB.AA2C.A832**

2