

**UNIVERSIDADE FEDERAL DO
ESPÍRITO SANTO**

PROGRAMA DE DISCIPLINA

DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA

DISCIPLINA : **SÉRIES TEMPORAIS I**

CÓDIGO : **STA 02397**

CARGA HORÁRIA SEMANAL :

TEORIA :

EXERCÍCIO:

LABORATÓRIO :

CARGA HORÁRIA SEMESTRAL: **90h**

PERÍODO : **a partir 2001/2**

CRÉDITOS : **05**

EMENTA:

Modelos de Previsão. Modelos de Decomposição. Modelos de Alisamento. Exponencial e Modelo de Auto Regressão. Modelos de Box e Jenkins. Previsão com os modelos acima.

PROGRAMA:

1. Introdução: Conceitos e objetivos da Análise de Séries Temporais
2. Modelos para Séries Temporais
 - 2.1 Processos Estocásticos
 - 2.2 Processos Estacionários
 - 2.3 Tipos de Modelos
3. Modelos de Decomposição: Componentes não observáveis
 - 3.1 Componente Tendência
 - 3.2 Componente Sazonal
4. Modelos de Alisamento Exponencial
 - 4.1 Médias Móveis Simples
 - 4.2 Alisamento Exponencial Simples
 - 4.3 Alisamento Exponencial Biparamétrico de Holt
 - 4.4 Alisamento Exponencial Sazonal de Holt-Winters
 - 4.5 Alisamento Exponencial Geral
5. Modelo de Auto-Regressão
6. Modelos de Box e Jenkins
 - 6.1 Modelos ARMA
 - 6.2 Modelos AR
 - 6.3 Modelos MA
 - 6.4 Modelos ARIMA
 - 6.5 Processo de construção de um modelo ARIMA
 - 6.6 Previsão com modelos ARIMA

ASSINATURA DO CHEFE DO DEPARTAMENTO

BIBLIOGRAFIA:

Previsão de Séries Temporais
Pedro Alberto Morettin e Clélia Maria de Castro Toloí - Editora Atual