

1983
MAT
11

UNIVERSIDAD DE BUENOS AIRES

FACULTAD DE CIENCIAS EXACTAS Y NATURALES

DEPARTAMENTO: DE MATEMATICA

ASIGNATURA: ANALISIS ESPECTRAL DE SERIES TEMPORALES

CARRERA/S.. Licenciatura en C. Matemáticas y Doctorado

ORIENTACION. Pura y Aplicada PLAN

CARACTER... Optativa no regular

DURACION DE LA MATERIA.... cuatrimestral

HORAS DE CLASE: a) TEORICAS.... 4 hs.

b) PRACTICAS..... hs.

c) TEORICO PRACTICAS..... hs.

d) TOTALES.... 4 hs.

ASIGNATURAS CORRELATIVAS: Funciones Reales I, Elementos de Probabilidades y
... Estadística

PROGRAMA

1. Ecuación de Wiener-Hopf
2. Filtros de predicción de error
3. Estimadores espectrales de máxima entropía
4. Fórmulas recursivas para el cálculo de los coeficientes del filtro
5. Procedimiento óptimo para el cálculo de coeficientes de reflexión
6. Modelo reticulado
7. Propiedades estadísticas del estimador de máxima entropía

Programa analítico con bibliografía: i. Teoría de Wiener del análisis espectral
ii. Procesos estocásticos estacionarios
iii. Representación espectral

BIBLIOGRAFIA:

1. The spectral analysis of time series, L.H. Koopmans
2. Time series analysis: forecasting and control, G.P. Box y G.M. Jenkins
3. Nonlinear methods of spectral analysis, Ed. by S. Haykin

Firma del profesor:

Aclaración de firma: Dr. Carlos E. D'Attellis

2do. cuatrimestre 1983

Dr. FAUSTO A. TORANZO
SUB-DIRECTOR
DEPARTAMENTO DE MATEMATICA