

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-Hop<sup>r</sup>
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

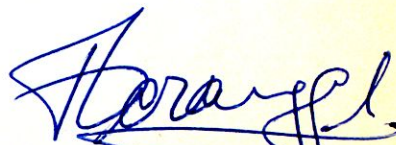
BIBLIOGRAFIA:

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