

67 MAT
1983

UNIVERSIDAD DE BUENOS AIRES
FACULTAD DE CIENCIAS EXACTAS Y NATURALES

DEPARTAMENTO:.. MATEMATICA ..
ASIGNATURA:.. SERIES DE TIEMPO ..
CARRERA/S Doctorado ..
ORIENTACION.....PLAN.....
CARACTER. Optativa ..
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:.....
.....

PROGRAMA

SERIES DE TIEMPO :

- 1) Procesos estacionarios Ergodicidad. Teorema ergódico
- 2) Modelos autoregresivos. Inversibilidad. Estimación de los parámetros, y predicción. consistencia y normalidad asintótica.
- 3) Modelos de promedios móviles y modelos ARMA. Estimación.
- 4) Secuencias y funciones aleatorias. Estacionaridad. Diferenciación e integración.
- 5) Definición de espectro. Representación espectral del proceso y la función de covarianza. Estimación del Espectro.
- 6) Predicción y filtros lineales.

BIBLIOGRAFIA

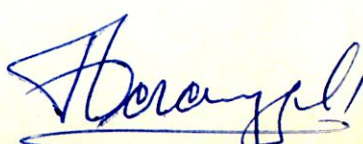
- 1) Anderson: The Analysis of Time Series
- 2) Yaglow: Stationary Random Functions
- 3) Bloomfield: Fourier Analysis of Series: An Introduction.

FIRMA DEL PROFESOR:

ACLARACION DE FIRMA: RICARDO FRAIMAN MAUS

2do. CUATRIMESTRE

Aprobado por Resolución DN 020/84


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