SERIES DE TIEMPO

Procesos ARMA estacionarios
Modelos ARIMA
Predicción en Modelos ARIMA
Identificación de modelos ARIMA
Estimación de modelos ARMA
Test de Bondad de ajuste de modelos ARMA
Modelos estacionales
Análisis de intervención y detección de outliers
Filtro de Kalman
Función de transferencia

BIBLIOGRAFIA

- Wei, W.W.S. *Time Series Analysis*, Addison Wesley
- P.J. Brockwell y R.A. Davis. *Time Series: Theory and Methods*. Segunda edición. Springer Verlag
- T.W. Anderson. *The Statistical Analysis of Time Series*. Wiley
- G.E.P. Box y G.M. Jenkins. *Time Series Analysis: Forecasting and Control*. Holden Day

1er. Cuatrimestre 2003

Firma del Profesor:

Aclaración de firma: Dr. Víctor J. YOHAI

Dr. JORGE ZILBER
DIRECTOR ADJUNTO
DEPTO. DE MATEMATICA