

**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

