

SERIES DE TIEMPO II

- 1. Análisis de intervención y detección de outliers
- 2. Filtro de Kalman
- 3. Función de transferencia
- 4. Estimadores Robustos de modelos ARMA
- 5. Modelos ARMA vectoriales
- 6. Modelos GARCH

BIBLIOGRAFIA

- 1. Wei, W. W. S. Time Series Analysis, Addison Wesley
- 2. P. J. Brockwell y R. A. Davis. Time Series: Theory and Methods. Segunda edición. Springer Verlag
- 3. T. W. Anderson. The Statistical Analysis of Time Series. Wiley
- 4. G. E. P. Box y G. M. Jenkins. Time Series Analysis: Forecasting and Control. Holden Day.
- 5. R.A. Maronna, R.D. Martin y V.J. Yohai. Robust Statistics: Theory and Methods, Wiley
- 6. R. S. Tsay. Analysis of Financial Time Series: Financial Econometrics, Wiley


2do. Cuatrimestre 2010

Firma del Profesor

v. j. yohai

Aclaración de firma:

Dr. Víctor J. YOHAI


 Dra. CRISTINA LOPEZ
 DIRECTORA ADJUNTA
 DEPARTAMENTO DE MATEMATICA
 F.C.E. Y N. - U.B.A.



Universidad de Buenos Aires
Facultad de Ciencias Exactas y Naturales

Referencia Expte. N° 498.752/08

Buenos Aires,

04 OCT 2010

VISTO

las notas presentadas por la Dra. Cristina López, Directora Adjunta del Departamento de Matemática, mediante las cuales eleva información y el programa del Curso de Posgrado **SERIES DE TIEMPO II** que dictará en el segundo cuatrimestre de 2010, el Dr. Víctor Yohai.

CONSIDERANDO:

lo actuado por la Comisión de Doctorado de la FCEN el 31/08/2010,
lo actuado por la Comisión de Enseñanza, Programas, Planes de Estudio y Posgrado,
lo actuado por este cuerpo en Sesión Ordinaria realizada en el día de la fecha,
en uso de las atribuciones que le confiere el Artículo N° 113° del Estatuto Universitario,

EL CONSEJO DIRECTIVO DE LA FACULTAD DE
CIENCIAS EXACTAS Y NATURALES
RESUELVE:

Artículo 1°: Autorizar el dictado del Curso de Posgrado **SERIES DE TIEMPO II** de 64 hs. de duración.

Artículo 2°: Aprobar el programa del Curso de Posgrado **SERIES DE TIEMPO II** obrante a fs 7 del expediente de la referencia.

Artículo 3°: Aprobar un puntaje máximo de dos (2) puntos para la Carrera del Doctorado.

Artículo 4°: Aprobar un arancel de 20 módulos y disponer que los montos recaudados en concepto de aranceles serán utilizados conforme a lo dispuesto por Resolución 072/2003

Artículo 5°: Comuníquese a la Dirección del Departamento de Matemática, a la Biblioteca de la FCEyN y a la Subsecretaría de Postgrado (con fotocopia del programa incluida) y a la Dirección de Alumnos (sin fotocopia del programa). Cumplido, archívese.

Resolución CD N°
SP/med 03/09/2010

▲ 2400


Dr. JAVIER LÓPEZ DE CASENAVE
SECRETARIO ACADEMICO ADJUNTO


Dr. JORGE ALIAGA
DECANO