

SERIES DE TIEMPO I

1. Series de tiempo. Estacionalidad. Función de autocorrelación
2. Predicción en series de tiempo estacionarias. Algoritmo de Durbin-Levinson.
Función de autocorrelación parcial
3. Modelos autoregresivos, promedios móviles y modelos mixtos autoregresivos –
promedios móviles (ARMA)
4. Modelos ARMA integrados (ARIMA)
5. Predicción en modelos ARIMA
6. Identificación de modelos ARIMA
7. Estimación de los parámetros de un modelos ARMA
8. Tests de Bondad de ajuste de modelos ARMA
9. Modelos ARIMA estacionales (SARIMA)

BIBLIOGRAFÍA

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


2do. Cuatrimestre 2010

Firma del Profesor

V. 192

Aclaración de firma:

Dr. Víctor 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° 493.722/08

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 I** que dictará en el segundo cuatrimestre de 2010, el Dr. Víctor Yohai.

La nota de la Directora del Departamento de Graduados de la FCEyN - UBA de fecha 31/08/2010

CONSIDERANDO:

lo actuado por la Comisión de Doctorado el 02/07/08

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 1º: Autorizar el dictado del Curso de Posgrado **SERIES DE TIEMPO I** de 64 hs. de duración.

Artículo 2º: Aprobar el programa del Curso de Posgrado **SERIES DE TIEMPO I** obrante a fs 17 del expediente de la referencia.

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

Artículo 4º: 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 5º: 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). Cumplido, archívese.

Resolución CD N°
SP/med 03/09/2010

2355
e
Dr. JAVIER LOPEZ DE CASENAVE
SECRETARIO ACADEMICO ADJUNTO

Dr. JORGE ALIAGA
DECANO