

15. ASIGNATURAS CORRELATIVAS *Cursada: prácticas de Estadística y Final: final de Estadística .*
16. PROGRAMA ANALITICO (Adjuntarlo) *se adjunta*
17. BIBLIOGRAFIA (indicar título del libro, autor, editorial y año de publicación; adjuntar luego del programa)

Fecha *1er. cuatrimestre 2013*

Firma del Profesor

Aclaración de firma

Dr. Chóper Curo
Dr. YOHAI, Víctor

Firma del Director

Sello aclaratorio

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

Nota: Para la validez de la información presentada se solicita que todas las páginas estén inicialadas y firmadas al final por el Sr. Director del Departamento/Instituto/Carrera o Responsable debidamente selladas y fechadas.

Otra: Se recuerda que los objetivos y los contenidos mínimos están incluidos en el Plan de Estudios respectivo y sólo son modificables por Resolución del Consejo Superior de la Universidad de Buenos Aires.

SERIES DE TIEMPO I

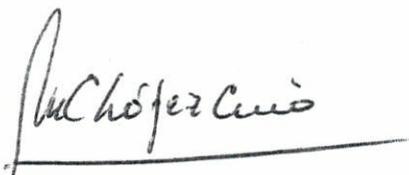
- Series de tiempo. Estacionalidad. Función de autocorrelación.
- Predicción en series de tiempo estacionarias. Algoritmos de Durbin – Levinson. Función de autocorrelación parcial.
- Modelos autorregresivos, promedios móviles y modelos mixtos autorregresivos –promedios móviles (ARMA).
- Modelos ARMA integrados (ARIMA).
- Predicción en modelos ARIMA.
- Identificación de modelos ARIMA.
- Estimación de los parámetros de un modelos ARMA.
- Tests de Bondad de ajuste de modelos ARMA.
- Modelos ARIMA estacionales (SARIMA).

BIBLIOGRAFIA

- WEI W. W. S. *Time Series Analysis*. Addison Wesley (1990).
- BROCKWELL P. J. y DAVIS R.A. *Time Series: Theory and Methods*. Springer Verlag (1991).
- BOX G.E.P. y JENKINS G. *Time Series Analysis Forecasting and Control*. Holden-Day (1970).
- ANDERSON T.W. *The Statistical Analysis of Time Series*. Wiley (1970).

1er. Cuatrimestre 2013

Firma del Profesor:



Aclaración de firma:



Dr. Víctor YOHAI



DR. CRISTINA LOPEZ
DIRECTORA ADJUNTA
DEPARTAMENTO DE MATEMÁTICA
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, 6 MAY 2013

VISTO

la nota presentada por la Dra. Cristina López, Directora Adjunta del Departamento de Matemática, mediante la cual eleva información y el programa del Curso de Posgrado **SERIES DE TIEMPO I** que dictará en el primer cuatrimestre de 2013, el Dr. Víctor Yohai.

CONSIDERANDO:

lo actuado por la Comisión de Doctorado el 05/03/2013

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 I** de 64 hs. de duración.

Artículo 2°: Aprobar el programa del Curso de Posgrado **SERIES DE TIEMPO I** obrante a fs 28 del expediente de la referencia.

Artículo 3°: Aprobar un puntaje de tres (3) 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). Cumplido, archívese.

Resolución CD N° 746
SP/med 16/04/2013

Dr. JORGE ALIAGA
DECANO

Dr. JORGE ALIAGA
DECANO