



---

## **Plano de Ensino**

EST049 - ANÁLISE E PREVISÃO DE SÉRIES TEMPORAIS II

Ano: 2009 Semestre: 3

### EMENTA

Modelos de regressão em séries temporais; regressão dinâmica. Modelos de função de transferência. Modelos estruturais e filtro de Kalman. Técnicas baseadas em inteligência computacional: redes neurais artificiais e lógica nebulosa.

### CONTEÚDO

1. Modelos ARIMA (revisão). Modelos SARIMA.
2. Modelos de função de transferência Box & Jenkins; modelos de intervenção.
4. Modelos de regressão linear aplicados a séries temporais; regressão dinâmica.
5. Modelos estruturais e filtro de Kalman
6. Modelos baseados em inteligência computacional: redes neurais, lógica nebulosa.

### BIBLIOGRAFIA

CHATFIELD, C. The Analysis of Time Series: An Introduction. 6ª ed. Chapman and Hall/CRC Press, 2003.  
MAKRIDAKIS, S.; WHEELWRIGHT S.C.; HYNDMAN R.J. (1998). Forecasting - Methods and applications. 3rd ed. John Wiley and Sons.  
MORETTIN, P.A.; TOLOI, C.M.C. Previsão de Séries Temporais. 2nd. ed. São Paulo: Edgard Blucher, 2006.  
MONTGOMERY, D.C.; JOHNSON, L.A.; GARDINER, J.S. Forecasting & Time Series Analysis. 2nd. ed. McGraw-Hill, 1990.

### BIBLIOGRAFIA COMPLEMENTAR

Em aberto