



## EMENTA DE DISCIPLINA

UNIDADE ACADÊMICA Faculdade de Engenharia	DEPARTAMENTO Eletrônica e Telecomunicações		
NOME DA DISCIPLINA SÉRIES TEMPORAIS	( ) OBRIGATÓRIA  (X) ELETIVA	C. HORÁRIA 60	CRÉDITOS 4
NOME DO PROJETO / CURSO Programa de Pós-Graduação em Engenharia Eletrônica  Área de Concentração: Sistemas Inteligentes e Automação	DISTRIBUIÇÃO DE CARGA HORÁRIA		
	TIPO DE AULA	C. HORÁRIA	Nº CRÉDITOS
	TEÓRICA	60	4
	PRÁTICA		
	TOTAL	60	4
PRÉ-REQUISITOS	(X) Disciplina do curso de mestrado acadêmico ( ) Disciplina do curso de mestrado profissional ( ) Disciplina do curso de doutorado		

### EMENTA

Técnicas Descritivas: sazonalidade, tendências, estacionariedade, autocorrelação. Modelos estocásticos para séries temporais: processos de médias móveis (MA), autoregressivos (AR), mistos (ARMA) e integrados (ARIMA). Previsão: método de amortecimento exponencial, previsão em modelos ARIMA. Modelos sazonais. Análise de Intervenção. Modelos não-lineares. Modelo de espaço de estados. Análise de Fourier. Análise Espectral. Modelos de memória longa.

### BIBLIOGRAFIA BÁSICA

P. A. Morettin e C. M. Toloi. Análise de Séries Temporais. São Paulo: Editora Edgard Blücher, 2004.  
M. West and J. Harrison. Bayesian Forecasting and Dynamic Models. Springer Verlag, 1997.  
G.E.P. Box and G. M. Jenkins. Time Series Analysis: Forecasting and Control. San Francisco: Holden-Day, 1976.  
P. Brockwell, and R. Davis. Introduction to Time Series and Forecasting. Springer Verlag, 1996.  
C. Chatfield. The Analysis of Time Series: An Introduction (5th edition). London: Chapman & Hall, 1996.  
P.J. Diggle. Time-Series: A Biostatistical Introduction. Oxford University Press, 1990.

### COORDENADOR DO PROJETO / CURSO

DATA	ASSINATURA