

EMENTA DE DISCIPLINA / ATIVIDADE OBRIGATÓRIA

UNIDADE ACADÊMICA Faculdade de Engenharia	DEPARTAMENTO Engenharia Eletrônica e Telecomunicações		
NOME DA DISCIPLINA FEN057336 - SÉRIES TEMPORAIS	<input type="checkbox"/> OBRIGATÓRIA <input checked="" type="checkbox"/> ELETIVA		
ÁREA DE CONCENTRAÇÃO/LINHA DE PESQUISA Sistemas Inteligentes e Automação e Redes de Telecomunicações	DISTRIBUIÇÃO DE CARGA HORÁRIA E CRÉDITO		
	TIPO DE AULA	C. HORÁRIA	Nº CRÉDITOS
	TEÓRICA	60	4
	PRÁTICA	-	-
	TOTAL	60	4
<input checked="" type="checkbox"/> Disciplina do curso de Mestrado Acadêmico <input type="checkbox"/> Disciplina do curso de Mestrado Profissional <input checked="" type="checkbox"/> Disciplina do curso de Doutorado <input type="checkbox"/> Disciplina do curso de Doutorado Profissional			

EMENTA

Técnicas Descritivas: sazonalidade, tendências, estacionariedade, autocorrelação. Modelos estocásticos para séries temporais: processos de médias móveis (MA), autorregressivos (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. Modelos de ARCH/GARCH Análise de Fourier. Análise Espectral. Aprendizado de Máquinas para séries temporais

BIBLIOGRAFIA BÁSICA

P. A. Morettin e C. M. Toloí. **Análise de Séries Temporais**,. São Paulo: Editora Edgard Blücher, 2006..
 R.J. Hyndman e G. Athanasopoulos, **Forecasting: principles and practice**, OTexts, 2021.
 J. Brownlee. **Deep learning for time series forecasting**. Victoria: Machine Learning Mastery, 2020.