

Plan 275 Lic. en CC. y Tec. Estadísticas

Asignatura 43956 APLICACION DE METODOS ESTADISTICOS

Grupo 1

Presentación

Series temporales, predicción

Programa Básico

Véase el programa de teoría de la asignatura (Aprobado por el Consejo de Departamento del Departamento de Estadística e Investigación Operativa)

Objetivos

Análisis y modelado de datos estadísticos temporales e interpretación de resultados.

Programa de Teoría

- 1.- Introducción. Modelos Univariantes
- 2.- Modelos heterocedásticos.
- 3.- Modelos de intervención y modelos de función de transferencia.
- 4.- Modelos multivariantes.

Programa Práctico

Las practicas se realizan en el laboratorio de estadistica 2 horas semanales o bisemanales. Se realizaran 3 o 4 practicas individuales consistente en el modelado de datos temporales.

Evaluación

Realización de examen (50 %) y entrega prácticas que se irán proponiendo de acuerdo a los temas explicados (50 %).

Bibliografía

BOX-JENKINS-REINSEL: Time Series Analysis: Forecasting and control Prentice Hall (1994)
BROCKWELL-DAVIS Time series. Theory and Methods Springer-Verlag (1987)
CHATFIELD The analysis of time series. Fifth edition. Chapman and Hall (1996)
FULLER. Introduction to Statistical Time Series. Second Edition . John Wiley & Sons (1996)
BRILLINGER Time series. Data analysis and theory McGraw (1981)
PANKRATZ . Forecasting with Dynamic Regression Models . John Wiley and Sons (1991)
CHRIS BROOKS: Introductory Econometrics for finance. Cambridge (2002)
DURBIN- KOOPMAN: Time series analysis by state space methods. Oxford (2001)