

## MAE 0325 – ANÁLISE DE SÉRIES TEMPORAIS 2º. Semestre/2020

Professora do curso: Chang Chiann, sala 210A, e-mail: chang@usp.br  
Monitora: Yangyang Chen, email: [yychen@ime.usp.br](mailto:yychen@ime.usp.br)

As aulas e listas estão na (até 20/09/2020):

<https://www.ime.usp.br/~chang/home/mae325/MAE325-An%e1lise%20de%20S%e9ries%20Temporais/>

As aulas e listas estão: [edisciplinas.usp.br](http://edisciplinas.usp.br)

O link para os livros está disponível nesta planilha:

<https://docs.google.com/spreadsheets/d/1SeczY8COFGa7iZsfeyneyQKjbZ1mZgQT2zmSFUguSLA>

Só é possível acessar com e-mail da USP e os livros armazenados no Drive são apenas para leitura.

aulas: segunda feira: 8:00 – 9:40; quinta feira: 10:00 – 11:40  
início da aula: dia 31/08/2020

link da sala de segunda-feira: <https://meet.google.com/qmh-bofz-edy>

link da sala de quinta-feira: <https://meet.google.com/eux-qapt-fso>

Programa:

1. Preliminares.
2. Conceitos básicos: processos estocásticos e séries temporais, estacionariedade, função de auto-covariância e tipos de modelos.
3. Tendência e Sazonalidade.
4. Modelos de suavização exponencial.
5. Processos ARMA estacionários (os modelos autoregressivos, de médias móveis e misto discretos) e modelos ARIMA: identificação, estimação, verificação e previsão.
6. Modelos Sazonais.
7. Análise de intervenção.
8. Modelos estruturais.
9. Introdução à análise espectral.

Data de provas:

1. 1ª. Prova: 26/10 (peso 1)
2. 2ª. Prova: 14/12 (peso 2)

Critério de avaliação:

Média = MP (70%) + ME (30%)

Bibliografia:

Morettin, P.A. e Toloi, C.M.C. (2018). Análise de Séries Temporais. Volume 1.