

SERIES CRONOLÓGICAS

Curso 1998-1999

1. Introducción
2. Técnicas descriptivas
3. Suavizado exponencial
4. Modelos probabilísticos
5. Estimación en el dominio del tiempo
6. Predicción
7. Modelos para datos estacionales
8. Análisis espectral

Referencias

Anderson, T. W. *The statistical analysis of time series*, Wiley
Box, G.E.P. and Jenkins, G.M. *Time series analysis, forecasting and control*.
Holden-Day
Chatfield, C. *The Analysis of time series. An introduction*. Chapman & Hall
Montgomery, D.C. and Johnson, L.A. *Forecasting and time series analysis*. Mc
Graw-Hill.

El objetivo de este curso es presentar una introducción al estudio de las series temporales. Se pretende cubrir las distintas etapas que en la práctica deben seguirse en el análisis de las series temporales, tanto los procedimientos descriptivos como los inferenciales, fundamentalmente en el dominio del tiempo.

El curso es cuatrimestral con 4 horas semanales. Se realizará un examen final que constará de dos partes: una teórica y otra práctica. Para superar la asignatura, el alumno deberá obtener una calificación media entre ambos ejercicios de al menos 5 puntos, debiendo tener al menos 3 puntos en cada uno de los ejercicios. Eventualmente el profesor podrá proponer trabajos o ejercicios cuya repercusión en la nota final será acordada con los alumnos.

Profesor: Fernando López Blázquez.

Horario de clases: L y X: 17:30-18:30, 19:00-20:00