

SME0808 Séries Temporais e Aprendizado Dinâmico
ICMC-USP Projeto 3

Entrega 21/12/2020

Este é o projeto final da disciplina. O objetivo é analisar uma ou mais séries temporais via modelos lineares dinâmicos. Pacotes do R, Python, etc podem ser utilizados. Escreva preferencialmente em Latex e entregue o arquivo pdf. Não copie figuras prontas de outros trabalhos ou páginas da internet, faça suas próprias figuras. O trabalho final deve conter as seguintes seções:

1 Introdução

Descrição do problema, dos dados a serem utilizados e objetivos da análise.

2 Metodologia

Descrição da(s) metodologia(s) utilizada(s). Aqui vai um pouco de teoria, fórmulas e descrição dos algoritmos.

3 Resultados/Aplicações

Aplique a(s) metodologia(s) da seção anterior a um ou mais conjuntos de dados. Forneça detalhes numéricos sobre as especificações das distribuições, dos algoritmos utilizados e sobre os custos computacionais. Seus resultados devem poder ser reproduzidos por outro pesquisador usando as mesmas ferramentas.

Inclua figuras e tabelas mas somente as que sejam realmente importantes e que estejam comentadas.

4 Conclusão/Discussão

Breve resumo do que foi feito e principais resultados. Comente possíveis dificuldades de programação ou convergência se for o caso. Fale sobre possíveis

questões em aberto, extensões da metodologia a problemas mais complexos e propostas de possíveis trabalhos futuros.

Alguns endereços com dados de séries temporais

- Organization for Economic Co-operation and Development (OECD)
- The National Bureau of Economic Research
- Time Series Data Library
- IPEADATA
- Economagic.com: Economic Time Series Page
- Macroeconomic Time Series
- National Environmental Satellite. Data and Information Center
- Banco de Informações Econômicas e Financeiras do Banco Central
- ECONSTATS - Global Economic Data
- Goddard Institute for Space Studies - NASA
- U.S. Department of Labor (Bureau of Labor Statistics)