

Series Temporales

Código: 104863
Créditos ECTS: 6

| Titulación | Tipo | Curso | Semestre |
|------------------------------|------|-------|----------|
| 2503852 Estadística Aplicada | OB | 3 | 1 |

Contacto

Nombre: Alejandra Cabaña Nigro

Correo electrónico: AnaAlejandra.Cabana@uab.cat

Uso de idiomas

Lengua vehicular mayoritaria: español (spa)

Algún grupo íntegramente en inglés: No

Algún grupo íntegramente en catalán: No

Algún grupo íntegramente en español: No

Otras observaciones sobre los idiomas

El material de clase estará en castellano, inglés y/o catalán

Equipo docente

Anna López Ratera

Prerequisitos

Es recomendable tener conocimientos de probabilidades, inferencia estadística y modelos lineales

Objetivos y contextualización

El objetivo de este curso es el de dar una primera mirada al mundo de las series temporales y sus aplicaciones.

Una serie temporal es una colección de observaciones hechas a lo largo del tiempo (o alguna otra magnitud ordenada). Las series temporales aparecen hoy en día en casi cualquier disciplina, por lo tanto, su análisis y la modelización del mecanismo aleatorio que las genera es de gran importancia desde el punto de vista teórico y práctico.

Se pretende que el alumno modele el mecanismo aleatorio que genera las observaciones, haga diagnósticos y predicciones.

Competencias

- Analizar datos mediante la aplicación de métodos y técnicas estadísticas, trabajando con datos de diversas tipologías.
- Aplicar el espíritu crítico y el rigor para validar o refutar argumentos tanto propios como de otras personas.
- Diseñar un estudio estadístico o de investigación operativa para la resolución de un problema real.
- Evaluar de manera crítica y con criterios de calidad el trabajo realizado.
- Formular hipótesis estadísticas y desarrollar estrategias para confirmarlas o refutarlas.

- Que los estudiantes puedan transmitir información, ideas, problemas y soluciones a un público tanto especializado como no especializado.
- Que los estudiantes sepan aplicar sus conocimientos a su trabajo o vocación de una forma profesional y posean las competencias que suelen demostrarse por medio de la elaboración y defensa de argumentos y la resolución de problemas dentro de su área de estudio.
- Que los estudiantes tengan la capacidad de reunir e interpretar datos relevantes (normalmente dentro de su área de estudio) para emitir juicios que incluyan una reflexión sobre temas relevantes de índole social, científica o ética.
- Resumir y descubrir patrones de comportamiento en la exploración de los datos.
- Seleccionar los modelos o técnicas estadísticas para aplicarlos a estudios y problemas reales, así como conocer las herramientas de validación de los mismos.
- Seleccionar y aplicar procedimientos más apropiados para la modelización estadística y el análisis de datos complejos.
- Utilizar correctamente un amplio espectro del software y lenguajes de programación estadísticos, escogiendo el más apropiado para cada análisis y ser capaz de adaptarlo a nuevas necesidades.
- Utilizar eficazmente la bibliografía y los recursos electrónicos para obtener información.

Resultados de aprendizaje

1. Analizar datos mediante modelos de series temporales.
2. Analizar datos mediante técnicas de inferencia usando software estadístico.
3. Analizar los residuos de un modelo estadístico.
4. Aplicar el espíritu crítico y el rigor para validar o refutar argumentos tanto propios como de otros.
5. Emplear gráficos de resumen de datos multivariados y de evolución temporal.
6. Emplear gráficos de visualización del ajuste y de la adecuación del modelo.
7. Establecer las hipótesis experimentales de la modelización.
8. Evaluar de manera crítica y con criterios de calidad el trabajo realizado.
9. Identificar distribuciones de las respuestas con el análisis de residuos.
10. Identificar las etapas en los problemas de modelización.
11. Identificar las suposiciones estadísticas asociadas a cada procedimiento.
12. Medir el grado de ajuste de un modelo estadístico.
13. Modificar ligeramente el software existente si el modelo estadístico propuesto lo requiere.
14. Que los estudiantes puedan transmitir información, ideas, problemas y soluciones a un público tanto especializado como no especializado.
15. Que los estudiantes sepan aplicar sus conocimientos a su trabajo o vocación de una forma profesional y posean las competencias que suelen demostrarse por medio de la elaboración y defensa de argumentos y la resolución de problemas dentro de su área de estudio.
16. Que los estudiantes tengan la capacidad de reunir e interpretar datos relevantes (normalmente dentro de su área de estudio) para emitir juicios que incluyan una reflexión sobre temas relevantes de índole social, científica o ética.
17. Reconocer la necesidad de emplear modelos para errores no independientes.
18. Utilizar eficazmente bibliografía y recursos electrónicos para obtener información.
19. Utilizar la inferencia estadística como instrumento de pronóstico y predicción en series temporales.
20. Validar los modelos utilizados mediante técnicas de inferencia adecuadas.

Contenido

1. Introducción. Anàlisi clàssica de series temporals. Tendència i estacionalitat. Models de regressió múltiple. Regressió lineal amb estructura d'errors AR(1). El test de Durbin-Watson.
2. Procesos estacionarios. Conceptos de estacionaridad, ejemplos. Simulación de series temporales.
3. Models ARIMA I. Los modelos MA(q). Modelos AR(p). El correlograma. Las ecuaciones de Yule-Walker. El operador de retardos y la relación entre los MA y los AR. La función de autocorrelación parcial.
4. Models ARIMA II. Modelos ARMA(p,q). Estimación de parámetros: método de los momentos, máxima verosimilitud, mínimos cuadrados condicionales e incondicionales. Modelos ARIMA(p,d,q) y SARIMA. La metodología de Box-Jenkins. Predicción. Estimación y predicción en models ARMA
5. Diagnostic checking and Forecasting. Criterios AIC y BIC. Anàlisi de residuos. Prediccions elementals y basadas en la representació AR(∞). IC para las predicciones

6. Modelos para series no estacionarias: ARCH/GARCH, ARMA con covariantes.

Metodología

En las dos horas semanales de teorías presentarán los resultados fundamentales y se realizarán ejercicios (con ordenador) y problemas.

En las dos horas de prácticas, que se realizarán con ordenador portátil en aula electrificada) se utilizará R para aplicar los modelos estudiados en teoría.

La perspectiva de género en la docencia va más allá de los contenidos de las asignaturas, ya que también implica una revisión de las metodologías docentes y las interacciones entre el alumnado y el profesorado, tanto dentro como fuera del aula. En este sentido, se emplearán metodologías docentes participativas, donde se genere un entorno igualitario, evitando ejemplos estereotipados en género y vocabulario sexista, con el objetivo de desarrollar el razonamiento crítico y el respeto a la diversidad y pluralidad de ideas, personas y situaciones, pues suelen ser más favorables a la integración y plena participación del estudiantado, y por eso se procurará su implementación efectiva en esta asignatura.

Actividades

| Título | Horas | ECTS | Resultados de aprendizaje |
|--------------------------|-------|------|---|
| Tipo: Dirigidas | | | |
| Clases prácticas | 26 | 1,04 | 1, 2, 3, 4, 8, 7, 5, 6, 9, 10, 11, 12, 13, 14, 15, 16, 17, 19, 20 |
| Clases teóricas | 26 | 1,04 | 1, 2, 3, 7, 5, 6, 9, 10, 11, 12, 15, 16, 17, 18, 19, 20 |
| Tipo: Autónomas | | | |
| Análisis de datos reales | 25 | 1 | 1, 2, 3, 4, 8, 7, 5, 6, 9, 10, 11, 12, 13, 14, 15, 16, 17, 18, 19, 20 |
| Trabajo personal | 60 | 2,4 | 1, 2, 3, 4, 8, 7, 5, 6, 9, 10, 11, 12, 13, 14, 15, 16, 17, 18, 19, 20 |

Evaluación

A lo largo del curso los alumnos tendrán que entregar regularmente trabajos de prácticas de ordenador. Habrá dos exámenes parciales que tendrán preguntas tanto de teoría como de práctica. Para poder presentarse al examen de recuperación habrá que tener como mínimo una nota de 3 en cada apartado anterior.

Actividades de evaluación

| Título | Peso | Horas | ECTS | Resultados de aprendizaje |
|---|------|-------|------|---|
| Entregas (problemas y prácticas de ordenador) | 0,4 | 8 | 0,32 | 1, 2, 3, 4, 8, 7, 5, 6, 9, 10, 11, 12, 13, 14, 15, 16, 17, 18, 19, 20 |
| Exámen | 0,4 | 3 | 0,12 | 1, 2, 3, 7, 9, 10, 11, 12, 14, 17, 19, 20 |
| Parcial 1 | 0,2 | 2 | 0,08 | 1, 2, 3, 7, 9, 10, 11, 12, 14, 17, 19, 20 |

Bibliografía

P.J. Brockwell and R.A. Davis: *Introduction to Time Series and Forecasting*. 2nd edit. Springer. 2002.

J.D. Cryer and K.S. Chan: *Time Series Analysis with Applications to R*. 2nd. edit. Springer. 2008

R.D. Peña. *Anàlisis de series temporales*. Alianza Editorial. 2005.

R.H. Shumway, and D.S. Stoffer: *Time Series Analysis and its Applications*. 3rd. edit. Springer. 2011.

R. Tsay *Analysis of Financial Time Series*, 3rd Edition, Wiley 2010