



Guía Docente

Datos Identificativos				
			2022/23	
Asignatura (*)	Series de Tempo	Código	614493123	
Titulación				
Descritores				
Ciclo	Período	Curso	Tipo	Créditos
Mestrado Oficial	2º cuatrimestre	Primeiro	Optativa	5
Idioma	Castelán			
Modalidade docente	Presencial			
Prerrequisitos				
Departamento	Matemáticas			
Coordinación	Aneiros Perez, German	Correo electrónico	german.aneiros@udc.es	
Profesorado	Aneiros Perez, German	Correo electrónico	german.aneiros@udc.es	
Web	eio.usc.es/pub/mte/			
Descrición xeral	<p>Preténdese modelizar o comportamento dunha serie de observacións dunha variable tomadas secuencialmente ó longo do tempo. Para iso, utilizaranse modelos estatísticos paramétricos. Estes modelos permitirannos comprender a dinámica da serie, así como predecir os seus futuros valores. A metodoloxía utilizada será ilustrada a través da súa aplicación a datos reais, para o que se fará uso do paquete estatístico R. O manexo de dito paquete no contexto específico das series de tempo será aprendido ó longo do curso.</p>			

Competencias / Resultados do título

Código	Competencias / Resultados do título
--------	-------------------------------------

Resultados da aprendizaxe

Resultados de aprendizaxe	Competencias / Resultados do título		
Coñecer os fundamentos da análise estatística de datos reais con dependencia temporal.	AM16	BP1	
	AM18	BP17	
	AM19		
	AM20		
	AM21		
	AM25		
Desenvolver autonomía para aplicar correctamente os métodos de series de tempo sobre conxuntos de datos reais, en contextos multidisciplinares.	AM17	BP2	CP12
	AM23	BP3	CP13
	AM24	BP5	CP14
		BP18	CP15
		BP20	
		BP21	
Saber presentar os resultados da análise dunha serie de tempo tanto a público especializado como non.		BP4	CP11
		BP19	

Contidos

Temas	Subtemas
-------	----------



<p>1. Series de tempo e procesos estocásticos.</p>	<p>1.1 Introducción. Gráfico secuencial. Características dunha serie de tempo. Exemplos.</p> <p>1.2 Os conceptos de proceso estocástico e serie de tempo. Procesos estocásticos. Series de tempo. Exemplos.</p> <p>1.3 Definicións asociadas a un proceso estocástico. Función de medias. Función de varianzas. Función de autocovarianzas. Función de autocorrelacións simples. Función de autocorrelacións parciais. Procesos estacionarios. Estimación da media, das autocovarianzas e das autocorrelacións simples e parciais. Proceso lineal. Proceso causal. Proceso invertible.</p> <p>1.4 A descomposición de Wold.</p>
<p>2. Modelos Box-Jenkins.</p>	<p>2.1 Introducción.</p> <p>2.2 Procesos ARMA: Definición e identificación. Procesos autorregresivos. Procesos de medias móbiles. Procesos autorregresivos de medias móbiles. Distribución asintótica das autocorrelacións simples e parciais muestrales. Identificación das ordes do ARMA a través das autocorrelacións simples e parciais muestrales.</p> <p>2.3 Procesos ARIMA. 2.3.1 Introducción. Diferenciación regular para eliminar a tendencia.</p> <p>2.3.2 Definición e identificación. Definición. Identificación das ordes do ARIMA a través das autocorrelacións simples e parciais muestrales do ARMA asociado.</p> <p>2.3.3 Estimación e diagnose. Estimación: mínimos cadrados, mínimos cadrados condicionados, máxima verosimilitude. Propiedades. Diagnose: métodos gráficos e contrastes de hipóteses.</p> <p>2.3.4 Selección do modelo e predicción. Criterios de información: AIC, AICc, BIC. Predicción puntual e intervalos de predicción.</p> <p>2.3.5 Aplicación a datos reais.</p> <p>2.4 Procesos ARIMA estacionais. 2.4.1 Introducción</p> <p>2.4.2 Procesos ARMA estacionais: Definición e identificación.</p> <p>2.4.3 Procesos ARMA estacionais multiplicativos: Definición e identificación.</p> <p>2.4.4 Procesos ARIMA estacionais: Definición e identificación.</p> <p>2.4.5 Procesos ARIMA estacionais: Estimación e diagnose.</p> <p>2.4.6 Procesos ARIMA estacionais: Selección do modelo e predicción.</p> <p>2.4.7 Medidas da adecuación das prediccións.</p> <p>2.4.8 Transformacións para estabilizar a varianza.</p> <p>2.4.9 Aplicación a datos reais.</p>



3. Tópicos adicionais.	<p>3.1 Análise de intervención. Efectos permanentes. Efectos transitorios. Función de transferencia. Construcción e estimación do modelo. Aplicación a datos reais.</p> <p>3.2 Valores atípicos. Atípico aditivo. Atípico innovativo. Detección de valores atípicos. Aplicación a datos reais.</p> <p>3.3 Regresión con series de tempo. Función de covarianzas cruzadas. Función de correlacións cruzadas: estimación e distribución asintótica. Correlación espuria. Construcción e estimación do modelo. Aplicación a datos reais.</p>
------------------------	---

Planificación				
Metodoloxías / probas	Competencias / Resultados	Horas lectivas (presenciais e virtuais)	Horas traballo autónomo	Horas totais
Sesión maxistral	A16 A18 A19 A20 A21 A23 A25 B1 B5 B17 B19 B20 B21 C14 C15	21	36	57
Prácticas de laboratorio	A17 A20 A21 A23 A24 B2 B3 B4 B5 B18 C11 C12 C13 C14 C15	14	42	56
Proba de resposta múltiple	A16 A17 A18 A19 A20 A21 A23 A24 A25	1.5	0	1.5
Proba práctica	A16 A17 A18 A19 A20 A21 A23 A24 A25 B1 B2 B3 B4 B5 B17 B18 B19 B20 B21 C11 C12 C13 C14 C15	1.5	0	1.5
Atención personalizada		9	0	9

*Os datos que aparecen na táboa de planificación son de carácter orientativo, considerando a heteroxeneidade do alumnado

Metodoloxías	
Metodoloxías	Descrición
Sesión maxistral	<p>Clases de tipo teórico impartidas polo profesor, nas que desenrolarán os contidos do Temario. Para iso, apoiarase na proxección de transparencias (a súa versión en pdf estará dispoñible online).</p> <p>Ditas transparencias serán facilitadas aos alumnos a través de Teams ou da web do mestrado.</p> <p>Proporáanse exercicios teórico-prácticos para que o alumno os realice de forma voluntaria (sen peso na avaliación).</p>



Prácticas de laboratorio	<p>Clases de tipo práctico impartidas polo profesor, nas que os alumnos participarán de xeito activo a través da realización de análises prácticas (para isto último, é necesario que os alumnos dispoñan no aula dun ordenador).</p> <p>O profesor desenrolará na clase distintos tipos de aplicacións a datos reais da teoría previamente exposta. Para iso, introducirá as ferramentas específicas de que dispón o paquete estatístico R. Posteriormente, será o alumno o que desenrole outras aplicacións coa axuda dun ordenador.</p> <p>Os scripts relativos ás aplicacións desenroladas polo profesor serán facilitados aos alumnos a través de Teams ou da web do mestrado. Tamén os correspondentes ás aplicacións levadas a cabo polos alumnos, pero unha vez que estes as teñan rematado.</p> <p>Proporase a análise de series de tempo e tamén cuestións relacionadas coas prácticas realizadas na clase para que o alumno as realice de forma voluntaria (sen peso na avaliación).</p>
Proba de resposta múltiple	Algunhas das probas da avaliación serán probas de resposta múltiple. Máis información sobre ditas probas pode ser vista na Sección 7: Avaliación.
Proba práctica	Algunhas das probas da avaliación consistirán na resolución de problemas de carácter práctico. Para iso, será necesaria a utilización do paquete estatístico R (utilizado nas clases prácticas). Máis información sobre este punto pode ser vista na Sección 7: Avaliación.

Atención personalizada

Metodoloxías	Descrición
Prácticas de laboratorio Sesión maxistral	Cualquera dúbida que se lle presente ao alumno ó longo das horas presenciais tratará de ser resolta instantaneamente por parte do profesor. Sin embargo, é posible que outras dúbidas surxan unha vez que o estudante profundice na materia no transcurso de horas non presenciais. Neste caso, resulta convinte que o alumno faga uso das tutorías individualizadas.

Avaliación

Metodoloxías	Competencias / Resultados	Descrición	Cualificación
Proba de resposta múltiple	A16 A17 A18 A19 A20 A21 A23 A24 A25	Refírese ás probas B1 e B2 da avaliación. Consisten en probas escritas tipo test de coñecementos teórico-prácticos. No caso da segunda oportunidade, refírese á proba D. Para detalles, véxase OBSERVACIÓNS AVALIACIÓN.	60
Proba práctica	A16 A17 A18 A19 A20 A21 A23 A24 A25 B1 B2 B3 B4 B5 B17 B18 B19 B20 B21 C11 C12 C13 C14 C15	Refírese ás probas A1 e A2 de la avaliación. Consisten na análise dunha serie de tempo a través das técnicas estatísticas e do software explicados na clase. No caso da segunda oportunidade, refírese á proba C. Para detalles, véxase OBSERVACIÓNS AVALIACIÓN.	40
Outros			

Observacións avaliación



Primeira oportunidade: Realizarase (ao 100%) a través de avaliación continua ao longo do cuatrimestre. Para iso programaranse catro probas: dúas delas orientadas a avaliar a compoñente aplicada da materia e as outras dúas a avaliar os coñecementos teóricos-prácticos. Máis concretamente:

1. Proba A1. Realizarase unha vez impartido o Tema 1 e as seccións 2.1, 2.2 e 2.3 do Tema 2. Consistirá na análise dunha serie de tempo a través das técnicas estatísticas e do software explicados ata ese momento.

2. Proba B1. Realizarase unha vez impartido o Tema 1 e as seccións 2.1, 2.2 e 2.3 do Tema 2. Consistirá na realización dunha proba tipo test de coñecementos teórico-prácticos adquiridos ata ese momento.

3. Proba A2. Realizarase unha vez impartida a sección 2.4 do Tema 2 e o Tema 3. Consistirá na análise dunha serie de tempo a través das técnicas estatísticas e do software explicados ata ese momento.

4. Proba B2. Realizarase unha vez impartida a sección 2.4 do Tema 2 e o Tema 3. Consistirá na realización dunha proba tipo test de coñecementos teórico-prácticos adquiridos en dita sección 2.4 do Tema 2 e no Tema 3.

Si se denotan a través de A1, B1, A2 e B2 as notas (sobre 10) obtidas nas probas A1, B1, A2 e B2, respectivamente, a nota final será:

(a) $0.2 \cdot A1 + 0.3 \cdot B1 + 0.2 \cdot A2 + 0.3 \cdot B2$, sempre e cando tanto $(A1+A2)/2$ como $(B1+B2)/2$ sexan maiores ou iguais que 3.

(b) $4.5(0.2 \cdot A1 + 0.3 \cdot B1 + 0.2 \cdot A2 + 0.3 \cdot B2)/7.2$, sempre e cando $(A1+A2)/2$ e/ou $(B1+B2)/2$ sexan menores que 3.

Como consecuencia do anterior, tense que para superar a materia será necesario obter un mínimo de 3 puntos tanto na nota media das probas A1 e A2 como na nota media das probas B1 e B2.

Segunda oportunidade: Constará dúas probas: unha delas orientada a avaliar a compoñente aplicada da materia e a outra a avaliar os coñecementos teórico-prácticos. Ambas abarcarán toda a materia impartida, e realizaranse na mesma data (unha a continuación da outra), que será fixada pola Comisión Académica do mestrado. Máis concretamente: 1. Proba C. Consistirá na análise dunha serie de tempo a través das técnicas estatísticas e do software explicados na clase.

2. Proba D. Consistirá na realización dunha proba tipo test de coñecementos teórico-prácticos relativos á materia explicada na clase.

Si se denotan a través de C e D as notas

(sobre 10) obtidas nas probas C e D, respectivamente, a nota final será:

(a) $0.4 \cdot C + 0.6 \cdot D$, sempre e cando tanto C como D sexan maiores ou iguais que 3.

(b) $4.5 \cdot (0.4 \cdot C + 0.6 \cdot D)/7.2$, sempre e cando C e/ou D sexan menores que 3.

Como consecuencia do anterior, se tense que para superar a materia será necesario obter un mínimo de 3 puntos tanto na proba C como na proba D.

Importante: Aos alumnos que non superen a materia na primeira oportunidade pero sí a parte aplicada (isto é, a media aritmética das puntuacións obtidas nas probas A1 e A2 non é inferior a 5) ou a parte teórico-práctica (isto é, a media aritmética das puntuacións obtidas nas probas B1 e B2 non é inferior a 5), consideraráselles dita media como puntuación obtida na parte superada e manteráselles para a segunda oportunidade. Así, na segunda oportunidade só realizarán a proba (aplicada ou teórico-práctica) non superada.

Fontes de información

Bibliografía básica

- Cowpertwait, P.S.P. e Metcalfe, A.V. (2009). Introductory Time Series with R.. Springer
- Cryer, J.D. e Chan, K-S. (2008). Time Series Analysis. With Applications in R.. Springer (2ª edición)
- Hyndman R.J. e Athanasopoulos, G. (2018). Forecasting: principles and practice. O Texts (2ª edición) (accesible online en <https://otexts.com/fpp2/>)



Bibliografía complementaria	<ul style="list-style-type: none">- Brockwell, P.J. y Davis, R.A. (2002). Introduction to Time Series and Forecasting.. Springer (2ª edición)- Peña, D. (2005). Análisis de Series Temporales.. Alianza Editorial- Shumway, R.H. y Stoffer, D.S. (2017). Time Series Analysis and Its Applications. With R Examples.. Springer (4ª edición) <p>
</p>
------------------------------------	---

Recomendacións

Materias que se recomenda ter cursado previamente

Inferencia Estatística/614493102

Modelos de Probabilidade/614493103

Materias que se recomenda cursar simultaneamente

Materias que continúan o temario

Observacións

Para

superar con éxito a materia é aconsellable a asistencia regular ás clases,

sendo fundamental o seguimento diario do traballo realizado na aula. Tamén

son recomendables coñecementos básicos de Probabilidade e de Inferencia

Estatística (por exemplo, ter cursado as materias Modelos de Probabilidade e

Inferencia Estatística do presente mestrado). Por último, o dispoñer de nocións xerais sobre o paquete estatístico R facilitará a comprensión do seu

uso no contexto específico das series de tempo. O desenrolo dos contidos da materia realizarase tendo en conta que as competencias a adquirir polo

alumnado deben cumprir co nivel MECES3. Os contidos que se inclúen nesta materia, orientada á análise de procesos con dependencia temporal,

estudiaranse de xeito teórico e aplicaranse a distintos exemplos. Incidirase no coñecemento das súas similitudes e diferencias con outras técnicas de

modelado de datos dependentes. Para os casos de realización fraudulenta de exercicios ou probas, será de aplicación o recollido nas respectivas

normativas das universidades participantes no Mestrado en Técnicas Estatísticas. Esta guía e os criterios e metodoloxías nela descritos están

suxeitos ás modificacións que se deriven de normativas e directrices das universidades participantes no Mestrado en Técnicas Estatísticas.

(*)A Guía docente é o documento onde se visualiza a proposta académica da UDC. Este documento é público e non se pode modificar, salvo casos excepcionais baixo a revisión do órgano competente dacordo coa normativa vixente que establece o proceso de elaboración de guías