

GUIA DOCENTE DE LA ASIGNATURA
SERIES TEMPORALES (Curso 2013-2014)

MÓDULO	MATERIA	CURSO	SEMESTRE	CRÉDITOS	TIPO
ESTADÍSTICA	Análisis de Datos y Series Temporales	3º	1º	6.0	Obligatorio
PROFESOR(ES)			DIRECCIÓN COMPLETA DE CONTACTO PARA TUTORÍAS (Dirección postal, teléfono, correo electrónico, etc.)		
<ul style="list-style-type: none"> Francisco Javier Alonso Morales 			Dpto. Estadística e Investigación Operativa, 1ª planta, Facultad de Ciencias. Despacho 8º. Correo electrónico: falonso@ugr.es		
			HORARIO DE TUTORÍAS		
			Jueves de 9 a 11 horas y de 13 a 14 horas, y viernes de 11 a 14 horas		
GRADO EN EL QUE SE IMPARTE			OTROS GRADOS A LOS QUE SE PODRÍA OFERTAR		
Grado en Estadística					
PRERREQUISITOS Y/O RECOMENDACIONES (si procede)					
Tener cursadas las asignaturas Cálculo de Probabilidades I y II, Estadística Matemática I y II y Modelos lineales. Tener conocimientos adecuados sobre: <ul style="list-style-type: none"> Cálculo matricial. 					
BREVE DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS (SEGÚN MEMORIA DE VERIFICACIÓN DEL GRADO)					
<ul style="list-style-type: none"> Análisis estadístico por la metodología de Box-Jenkins. Modelos de función de transferencia. Introducción al análisis espectral de series temporales. 					
COMPETENCIAS GENERALES Y ESPECÍFICAS					
Competencias generales G01. Poseer los conocimientos básicos de los distintos módulos que, partiendo de la base de la educación secundaria general, y apoyándose en libros de texto avanzados, se desarrollan en la propuesta de título de Grado en Estadística que se presenta. G02. Saber aplicar los conocimientos básicos de cada módulo a su trabajo o vocación de una forma profesional y poseer las competencias que suelen demostrarse por medio de la elaboración y defensa de					



ugr | Universidad
de Granada

Página 1

INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Código de verificación: U2UdVFYqfdBB2cNtpusWUH5CKCJ3NmbA . Permite la verificación de la integridad de una copia de este documento electrónico en la dirección: <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp>

FECHA Y HORA	04/08/2013 11:38:36	PÁGINA	1 / 5
FIRMADO POR	CERT. EXPEDIDO	CERT. CADUCIDAD	
23191644P ANDRES GONZALEZ CARMONA	2011-06-03 vie 08:38:22 +0200	2014-06-03 mar 08:38:22 +0200	



U2UdVFYqfdBB2cNtpusWUH5CKCJ3NmbA

argumentos y la resolución de problemas dentro de la Estadística y ámbitos en que esta se aplica directamente.

G03. Saber reunir e interpretar datos relevantes para emitir juicios que incluyan una reflexión sobre temas relevantes de índole social, científica o ética.

G04. Poder transmitir información, ideas, problemas y sus soluciones, de forma escrita u oral, a un público tanto especializado como no especializado.

G05. Haber desarrollado aquellas habilidades de aprendizaje necesarias para emprender estudios posteriores con un alto grado de autonomía.

G06. Saber utilizar herramientas de búsqueda de recursos bibliográficos.

G08. Poseer habilidades y aptitudes que favorezcan el espíritu emprendedor en el ámbito de aplicación y desarrollo de su formación académica.

Competencias específicas

E01. Conocer los fundamentos básicos del razonamiento estadístico, en el diseño de estudios, en la recogida de información, en el análisis de datos y en la extracción de conclusiones.

E02. Conocer, saber seleccionar y saber aplicar, técnicas de adquisición de datos para su tratamiento estadístico.

E03. Conocer los fundamentos teóricos y saber aplicar modelos y técnicas estadísticas en estudios y problemas reales en diversos ámbitos científicos y sociales.

E04. Saber seleccionar los modelos o técnicas estadísticas para su aplicación en estudios y problemas reales en diversos ámbitos científicos y sociales, así como conocer herramientas de validación de los mismos.

E07. Conocer los conceptos y herramientas matemáticas necesarias para el estudio de los aspectos teóricos y prácticos de la Probabilidad, la Estadística y la Investigación Operativa.

E08. Conocer y saber utilizar aplicaciones informáticas de análisis estadístico, cálculo numérico y simbólico, bases de datos, visualización gráfica y optimización, que sean útiles para la aplicación y desarrollo de las técnicas estadísticas.

E10. Tomar conciencia de la necesidad de asumir las normas de ética profesional y las relativas a la protección de datos y del secreto estadístico, como premisas que deben guiar la actividad profesional como profesionales de la Estadística.

OBJETIVOS (EXPRESADOS COMO RESULTADOS ESPERABLES DE LA ENSEÑANZA)

- Saber determinar a qué situaciones reales pueden aplicarse diferentes técnicas estadísticas y aplicarlas mediante programas de ordenador.
- Conocer las dificultades y limitaciones que se plantean al utilizar distintos procedimientos para el análisis de series temporales.
- Obtener conclusiones oportunas y modelos adecuados tras la aplicación de técnicas y saber expresarlas adecuadamente

TEMARIO DETALLADO DE LA ASIGNATURA

TEMARIO TEÓRICO:

- **TEMA 1: INTRODUCCIÓN**
Conceptos básicos, terminología y notación. Naturaleza de las series temporales. Objetivos del análisis de series temporales. Enfoques del análisis de series temporales. Procesos estocásticos. Procesos estacionarios. Función de autocorrelación. Teorema de descomposición de Wold. Modelos ARMA y ARIMA.
- **TEMA 2: MÉTODO BOX-JENKINS PARA EL ANÁLISIS DE SERIES TEMPORALES**
Filosofía del método Box-Jenkins. Funciones de autocorrelación y de autocorrelación parcial.



Código de verificación: U2UdVFYqfdBB2cNtpusWUH5CKCJ3NmbA . Permite la verificación de la integridad de una copia de este documento electrónico en la dirección: <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp>

FECHA Y HORA

04/08/2013 11:38:36

PÁGINA

2 / 5

FIRMADO POR

CERT. EXPEDIDO

CERT. CADUCIDAD

23191644P ANDRES GONZALEZ CARMONA

2011-06-03 vie 08:38:22
+0200

2014-06-03 mar
08:38:22 +0200



U2UdVFYqfdBB2cNtpusWUH5CKCJ3NmbA

Construcción de modelos ARMA: Identificación, estimación y validación. Predicción.

- **TEMA 3: MODELIZACIÓN DE SERIES TEMPORALES ESTACIONALES**
Modelos ARIMA estacionales multiplicativos. Construcción de modelos estacionales por el método de Box-Jenkins: Identificación, estimación y validación. Predicción. Otros enfoques.
- **TEMA 4: REGRESIÓN DINÁMICA Y ANÁLISIS DE INTERVENCIÓN**
Modelos de regresión dinámica. Función de correlaciones cruzadas. Función de transferencia. Construcción de modelos de regresión dinámica: Identificación, estimación y validación. Predicción. Análisis de intervención.
- **TEMA 5: INTRODUCCIÓN AL ANÁLISIS ESPECTRAL**
Análisis espectral de un proceso estacionario. Filtros lineales y transformación de la función de densidad espectral. Periodograma y su relación con el correlograma. Estimación del espectro, propiedades muestrales. Estimación consistente mediante ventanas espectrales. Aplicación a la modelización de series.

TEMARIO PRÁCTICO:

Prácticas de Laboratorio

Se realizarán prácticas con datos reales y simulados mediante *software* estadístico relativas a los contenidos tratados en el programa de teoría.

BIBLIOGRAFÍA

BIBLIOGRAFÍA FUNDAMENTAL:

- ABRAHAM, B. y LEDOLTER, J. (1983): *Statistical Methods for Forecasting*. John Wiley & Sons, New York.
- BOX, G.E.P. y JENKINS, G.M. (1976): *Time Series Analysis: Forecasting and Control*. Holden-Day, San Francisco.
- BOWERMANN, B.L. y O'CONNELL, R.T. (1993): *Forecasting and Time Series: An Applied Approach*. Duxbury Press, Belmont.
- CHATFIELD, C. (1989, cuarta ed.): *The Analysis of Time Series: An Introduction*. Chapman and Hall.
- MAKRIDAKIS, S., WHEELWRIGHT, S.C. y HYNDMAN, R.J. (1998): *Forecasting Methods and Applications*. John Wiley & Sons, New York.
- PANKRATZ, A. (1983): *Forecasting with Univariate Box-Jenkins Models*. Wiley.
- PANKRATZ, A. (1991): *Forecasting with Dynamic Regression Models*. Wiley.
- PEÑA, D. (1989, segunda ed.): *Estadística: Modelos y Métodos, 2 (Modelos Lineales y Series Temporales)*. Alianza Universidad Textos.
- URIEL, E. (1984): *Series Temporales. Modelos ARIMA*. Paraninfo.

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA:

- Kirchgässner, Gebhard. (2007) *Introduction to Modern Time Series Analysis*. Springer-Verlag.
- Robert Shumway and David Stoffer (2006) *Time Series Analysis and Its Applications*. Springer-Verlag.
- Jonathan D. Cryer and Kung-Sik Chan (2008) *Time Series Analysis with Applications in R*. Springer-Verlag.
- Peter Brockwell and Richard Davis (2002) *Introduction to Time Series and Forecasting*. Springer-Verlag.
- Luetkepohl, Helmut(Editor) (2004) *Applied Time Series Econometrics*. Cambridge University Press.

Página 3



ugr | Universidad de Granada

INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Código de verificación: U2UdVFYqfdBB2cNtpusWUH5CKCJ3NmbA . Permite la verificación de la integridad de una copia de este documento electrónico en la dirección: <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp>

FECHA Y HORA	04/08/2013 11:38:36	PÁGINA	3 / 5
FIRMADO POR	CERT. EXPEDIDO	CERT. CADUCIDAD	
23191644P ANDRES GONZALEZ CARMONA	2011-06-03 vie 08:38:22 +0200	2014-06-03 mar 08:38:22 +0200	



U2UdVFYqfdBB2cNtpusWUH5CKCJ3NmbA

ENLACES RECOMENDADOS

La bibliografía complementaria son libros electrónicos adquiridos por la universidad de Granada.

METODOLOGÍA DOCENTE

- Clases teóricas.
- Clases de problemas y prácticas de ordenador
- Seminarios y exposición de trabajos
- Tutorías académicas
- Trabajo personal del alumno

Las anteriores actividades formativas se desarrollarán desde una metodología participativa y aplicada centrada en el trabajo del estudiante (presencial y no presencial / individual y grupal) según la siguiente distribución aproximada (atendiendo a las indicaciones generales de los módulos del grado):

- Un 30% de docencia presencial en el aula.
- Un 60% de estudio individualizado del alumno, búsqueda, consulta y tratamiento de información, resolución de problemas y casos prácticos, y realización de trabajos y exposiciones.
- Un 10% para tutorías colectivas y evaluación.

Para esta asignatura, la relación de cada actividad formativa con las competencias a adquirir es la siguiente:

Clases de teoría	Competencias generales: G01, G03, G05. Competencias específicas: E01, E03, E04, E07.
Clases de problemas y prácticas de ordenador	Competencias generales: G01, G02. Competencias específicas: E04, E07, E08.
Seminarios y exposición de trabajos	Competencias generales: G01, G02, G03, G04, G05, G06, G08. Competencias específicas: E02, E04, E07, E08, E10.
Tutorías	Competencias generales: G01, G03, G04, G05. Competencias específicas: E01, E03, E04, E07, E08.
Trabajo personal del alumno	Competencias generales: G01, G02, G03, G04, G05, G06, G08. Competencias específicas: E01, E02, E03, E04, E07, E08, E10.

EVALUACIÓN (INSTRUMENTOS DE EVALUACIÓN, CRITERIOS DE EVALUACIÓN Y PORCENTAJE SOBRE LA CALIFICACIÓN FINAL, ETC.)

La evaluación se realizará a partir de la medición de las diversas actividades que realizan los alumnos.

La superación de cualquiera de las pruebas no se logrará sin un conocimiento uniforme y equilibrado de toda la materia. Se tendrán en cuenta los siguientes procedimientos, aspectos y criterios, asignando a cada uno de ellos un porcentaje que se mantenga en el rango indicado y de tal manera que la suma de los tres constituya el total (100%) de la calificación:



Código de verificación: U2UdVFYqfdBB2cNtpusWUH5CKCJ3NmbA . Permite la verificación de la integridad de una copia de este documento electrónico en la dirección: <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp>

FECHA Y HORA

04/08/2013 11:38:36

PÁGINA

4 / 5

FIRMADO POR

CERT. EXPEDIDO

CERT. CADUCIDAD

23191644P ANDRES GONZALEZ CARMONA

2011-06-03 vie 08:38:22
+0200

2014-06-03 mar
08:38:22 +0200



U2UdVFYqfdBB2cNtpusWUH5CKCJ3NmbA

Evaluación de la materia		Valor
Pruebas específicas de conocimientos, orales y escritas. Resolución de ejercicios		40 - 50%
Trabajos y seminarios. Producciones de los alumnos, individuales o de grupo, a través de cuadernos de trabajo presentaciones, eportfolios, entrevistas, y cuestionarios		40 - 50%
Participación, actitud y esfuerzo personal de los alumnos en las actividades formativas. Autoevaluación razonada		5 - 15%

EVALUACIÓN ÚNICA FINAL

Evaluación de la materia		Valor
Pruebas específicas de conocimientos, orales y escritas. Resolución de ejercicios		60 - 80%
Análisis de unos datos temporales mediante modelización de Box-Jenkins		20 - 40%

INFORMACIÓN ADICIONAL



ugr

Universidad
de Granada

Página 5

INFORMACIÓN SOBRE TITULACIONES DE LA UGR
<http://grados.ugr.es>

Código de verificación: U2UdVFYqfdBB2cNtpusWUH5CKCJ3NmbA . Permite la verificación de la integridad de una copia de este documento electrónico en la dirección: <https://sede.ugr.es/verifirma/pfinicio.jsp>

FECHA Y HORA	04/08/2013 11:38:36	PÁGINA	5 / 5
FIRMADO POR		CERT. EXPEDIDO	CERT. CADUCIDAD
23191644P ANDRES GONZALEZ CARMONA		2011-06-03 vie 08:38:22 +0200	2014-06-03 mar 08:38:22 +0200



U2UdVFYqfdBB2cNtpusWUH5CKCJ3NmbA