

Escuela de Doctorado y Estudios de Posgrado

Máster Universitario en Desarrollo Regional

GUÍA DOCENTE DE LA ASIGNATURA :

**Análisis de Series Temporales
(2020 - 2021)**

1. Datos descriptivos de la asignatura

Asignatura: Análisis de Series Temporales	Código: 215481203
<ul style="list-style-type: none">- Centro: Escuela de Doctorado y Estudios de Postgrado- Lugar de impartición: Facultad de Economía, Empresa y Turismo.- Titulación: Máster Universitario en Desarrollo Regional- Plan de Estudios: 2013 (Publicado en 2014-04-10)- Rama de conocimiento: Ciencias Sociales y Jurídicas- Itinerario / Intensificación:- Departamento/s: Economía Aplicada y Métodos Cuantitativos- Área/s de conocimiento: Métodos Cuantitativos para la Economía y La Empresa- Curso: 1- Carácter: Obligatoria- Duración: Segundo cuatrimestre- Créditos ECTS: 3,0- Modalidad de impartición: Semipresencial- Horario: Enlace al horario- Dirección web de la asignatura: http://www.campusvirtual.ull.es- Idioma: Castellano	

2. Requisitos para cursar la asignatura

No se han establecido

3. Profesorado que imparte la asignatura

Profesor/a Coordinador/a: CARMEN GLORIA MARTIN RODRIGUEZ
- Grupo: 1
General <ul style="list-style-type: none">- Nombre: CARMEN GLORIA- Apellido: MARTIN RODRIGUEZ- Departamento: Economía Aplicada y Métodos Cuantitativos- Área de conocimiento: Métodos Cuantitativos para la Economía y La Empresa

Contacto

- Teléfono 1: **922317034**
- Teléfono 2:
- Correo electrónico: **gmartinr@ull.edu.es**
- Correo alternativo:
- Web: **<http://www.campusvirtual.ull.es>**

Tutorías primer cuatrimestre:

Desde	Hasta	Día	Hora inicial	Hora final	Localización	Despacho
Todo el cuatrimestre		Martes	10:00	13:00	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	Estadística y Econometría, 4º piso, despacho nº 9
Todo el cuatrimestre		Martes	17:00	20:00	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	Estadística y Econometría, 4º piso, despacho nº 9

Observaciones:

Tutorías segundo cuatrimestre:

Desde	Hasta	Día	Hora inicial	Hora final	Localización	Despacho
Todo el cuatrimestre		Martes	10:00	13:00	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	Estadística y Econometría, 4º piso, despacho nº 9
Todo el cuatrimestre		Martes	17:00	20:00	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	Estadística y Econometría, 4º piso, despacho nº 9

Observaciones: Las tutorías de los martes de 17:00 a 20:00 horas son virtuales. Para llevar a cabo la tutoría se hará uso del correo electrónico.

Profesor/a: JOSE JUAN CACERES HERNANDEZ

- Grupo: **1**

General - Nombre: JOSE JUAN - Apellido: CACERES HERNANDEZ - Departamento: Economía Aplicada y Métodos Cuantitativos - Área de conocimiento: Métodos Cuantitativos para la Economía y La Empresa						
Contacto - Teléfono 1: - Teléfono 2: - Correo electrónico: jcaceres@ull.es - Correo alternativo: - Web: http://www.campusvirtual.ull.es						
Tutorías primer cuatrimestre:						
Desde	Hasta	Día	Hora inicial	Hora final	Localización	Despacho
Todo el cuatrimestre		Lunes	12:45	13:45	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10
		Lunes	15:15	16:15	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10
		Miércoles		11:30	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10
		Miércoles	16:00	18:00	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10
Observaciones:						
Tutorías segundo cuatrimestre:						
Desde	Hasta	Día	Hora inicial	Hora final	Localización	Despacho
Todo el cuatrimestre		Lunes	10:30	13:30	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10

		Lunes	16:30	19:30	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10
Observaciones:						

Profesor/a: FRANCISCO JAVIER MARTIN ALVAREZ						
- Grupo: 1						
General - Nombre: FRANCISCO JAVIER - Apellido: MARTIN ALVAREZ - Departamento: Economía Aplicada y Métodos Cuantitativos - Área de conocimiento: Métodos Cuantitativos para la Economía y La Empresa						
Contacto - Teléfono 1: 922317037 - Teléfono 2: - Correo electrónico: fjmartin@ull.es - Correo alternativo: - Web: http://www.campusvirtual.ull.es						
Tutorías primer cuatrimestre:						
Desde	Hasta	Día	Hora inicial	Hora final	Localización	Despacho
Todo el cuatrimestre		Martes	09:30	13:30	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	Estadística y Econometría, despacho 6
Todo el cuatrimestre		Martes	16:00	18:00	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	Online
Observaciones: Las tutorías de los martes de 16:00 a 18:00 horas se realizarán a través del Chat del Aula Virtual, del correo institucional de la ULL o bien a través de sesiones de videoconferencia con el Google Meet						
Tutorías segundo cuatrimestre:						
Desde	Hasta	Día	Hora inicial	Hora final	Localización	Despacho

Todo el cuatrimestre		Miércoles	16:00	18:00	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	Online
Todo el cuatrimestre		Jueves	11:30	13:30	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	Estadística y Econometría, despacho 6
Todo el cuatrimestre		Jueves	16:00	18:00	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	Estadística y Econometría, despacho 6

Observaciones: Las tutorías de los miércoles de 16:00 a 18:00 horas se realizarán a través del Chat del Aula Virtual, del correo institucional de la ULL o bien a través de sesiones de videoconferencia con el Google Meet

4. Contextualización de la asignatura en el plan de estudio

Bloque formativo al que pertenece la asignatura: **Metodología y Técnicas de Análisis**

Perfil profesional: **Saber aplicar técnicas de análisis de series temporales en el estudio del desarrollo regional.**

5. Competencias

Competencias Específicas

CE-5 - Saber determinar las técnicas y/o modelos estadístico-económicos más adecuados al logro de los objetivos de la política económica regional

Competencias Generales

CG-2 - Aplicar modelos de desarrollo económico y/o social en el ámbito regional

CG-3 - Implementar la planificación económica y/o social desde una perspectiva regional

6. Contenidos de la asignatura

Contenidos teóricos y prácticos de la asignatura

- Profesor/a: Gloria Martín Rodríguez, José Juan Cáceres Hernández y Francisco Javier Martín Álvarez

- Temas

Tema 1. Introducción

Tema 2. Análisis clásico de series temporales
 Tema 3. Proceso estocástico y modelos ARIMA
 Tema 4. Raíces unitarias y cointegración

Actividades a desarrollar en otro idioma

7. Metodología y volumen de trabajo del estudiante

Descripción

En esta asignatura se presentan dos procedimientos de análisis univariante de series temporales económicas. En concreto, el enfoque clásico y los modelos ARIMA. Finalmente, y desde la perspectiva del análisis multivariante, se aborda el concepto de raíz unitaria y la noción de cointegración entre procesos integrados. La utilidad de estos modelos se pone de manifiesto a través de su aplicación a diferentes casos de estudio de interés en la política económica regional.

Actividades formativas en créditos ECTS, su metodología de enseñanza-aprendizaje y su relación con las competencias que debe adquirir el estudiante

Actividades formativas	Horas presenciales	Horas de trabajo autónomo	Total horas	Relación con competencias
Clases teóricas	25,00	0,00	25,0	[CG-3], [CG-2], [CE-5]
Realización de trabajos (individual/grupal)	5,00	22,00	27,0	[CG-3], [CG-2], [CE-5]
Preparación de exámenes	0,00	12,00	12,0	[CG-3], [CG-2], [CE-5]
Realización de exámenes	2,00	0,00	2,0	[CG-3], [CG-2], [CE-5]
Asistencia a tutorías	9,00	0,00	9,0	[CG-3], [CG-2], [CE-5]
Total horas	41,00	34,00	75,00	
		Total ECTS	3,00	

8. Bibliografía / Recursos

Bibliografía Básica

CÁCERES HERNÁNDEZ, JJ, G MARTÍN RODRÍGUEZ y FJ MARTÍN ÁLVAREZ (2008) Introducción al Análisis Univariante de Series Temporales Económicas. Delta Publicaciones

Bibliografía Complementaria

BOX, GEP y GM JENKINS (1976) Time Series Analysis: Forecasting and Control. Holden-Day.
FULLER, W (1976) Introduction to statistical time series. John Wiley & Sons.
HARVEY, AC (1989) Forecasting, Structural Time Series and the Kalman Filter. Cambridge University Press.
OTERO, JM (1993) Econometría. Series Temporales y Predicción. Editorial AC.
PEÑA, D (1986) Estadística. Modelos y Métodos II. AUT.
PEÑA, D (2010) Análisis de Series Temporales. Alianza Editorial.

Otros Recursos

Programas informáticos de tratamiento estadístico: Excel y Gretl

9. Sistema de evaluación y calificación

Descripción

La calificación obtenida será la que resulte de la resolución de ejercicios (70%), realización de exámenes (15%) y participación activa en clase (15%). Este sistema de evaluación será explicado en la primera sesión presencial y en el aula virtual de la asignatura. En caso de no superar la asignatura por el sistema anterior, el alumno será evaluado exclusivamente a través de un examen del contenido completo de la materia en cualquiera de las convocatorias oficiales.

Estrategia Evaluativa

Tipo de prueba	Competencias	Criterios	Ponderación
Pruebas objetivas	[CG-3], [CG-2], [CE-5]	* Resolución de ejercicios, casos prácticos y exámenes presenciales o virtuales	85,00 %
Asistencia a las actividades presenciales	[CG-3], [CG-2], [CE-5]	La calificación se obtiene ponderando por el % de asistencia efectiva	15,00 %

10. Resultados de Aprendizaje

Saber aplicar técnicas de análisis de series temporales en el estudio del desarrollo regional

11. Cronograma / calendario de la asignatura

Descripción

*La distribución de los temas por semana es orientativa y puede sufrir cambios según las necesidades de organización docente.

Segundo cuatrimestre

Semana	Temas	Actividades de enseñanza aprendizaje	Horas de trabajo presencial	Horas de trabajo autónomo	Total
Semana 5:	Tema 1 a 4	Clases teórico-prácticas y aplicación a diferentes casos de estudio.	39.00	22.00	61.00
Semana 15 a 17:	Evaluación	Preparación y evaluación final	2.00	12.00	14.00
Total			41.00	34.00	75.00