

Escuela de Doctorado y Estudios de Posgrado

Máster Universitario en Desarrollo Regional

GUÍA DOCENTE DE LA ASIGNATURA :

**Análisis de Series Temporales
(2022 - 2023)**

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
<ul style="list-style-type: none">- 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.es - Correo alternativo: gmartinr@ull.edu.es - 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, despacho nº 9
Todo el cuatrimestre		Martes	17:00	20:00	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	Estadística y Econometría, 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, despacho nº 9
Todo el cuatrimestre		Martes	17:00	20:00	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	Estadística y Econometría, despacho nº 9

Observaciones:

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
26-09-2022	27-11-2022	Lunes	12:45	13:45	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10
26-09-2022	27-11-2022	Lunes	15:15	16:15	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10
26-09-2022	27-11-2022	Miércoles	09:30	11:30	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10
26-09-2022	27-11-2022	Miércoles	16:00	18:00	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10
28-11-2022	29-01-2023	Martes	10:30	13:30	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10
28-11-2022	29-01-2023	Martes	16:30	19:30	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10
Observaciones: Las tutorías serán presenciales						
Tutorías segundo cuatrimestre:						
Desde	Hasta	Día	Hora inicial	Hora final	Localización	Despacho

Todo el cuatrimestre		Martes	10:30	13:30	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10
Todo el cuatrimestre		Martes	16:30	19:30	Facultad de Economía, Empresa y Turismo - GU.5A	UDI Estadística y Econometría, Despacho 10
Observaciones: Las tutorías serán presenciales.						

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	
Observaciones: Las tutorías de los martes de 16:00 a 18:00 horas son virtuales, se realizarán a través de la herramienta 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	
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 son virtuales, se realizarán a través de la herramienta 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

Contenidos:

1. Introducción
2. Análisis clásico de series temporales
3. Procesos estocásticos y modelos ARIMA
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, JJ, G MARTÍN y FJ MARTÍN (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

1ª Convocatoria:

Evaluación continua: la calificación obtenida será la que resulte de la resolución de ejercicios del Enfoque Clásico y modelos ARIMA (40%), resolución de ejercicios sobre los conceptos de raíz unitaria y cointegración (30%), informe sobre la aplicación de los diferentes procedimientos de análisis a casos de estudio (15%) y participación activa en clase (15%). La resolución de ejercicios requiere el uso de software informático como Excel y Gretl.

Evaluación única: preguntas cortas y resolución de ejercicios sobre el contenido completo de la materia. La resolución de ejercicios requiere el uso de software informático como Excel y Gretl.

2ª Convocatoria:

Evaluación única: preguntas cortas y resolución de ejercicios sobre el contenido completo de la materia. La resolución de ejercicios requiere el uso de software informático como Excel y Gretl.

El sistema de evaluación se aplicará conforme al Reglamento de Evaluación y Calificación de la ULL.

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	70,00 %
Informes memorias de prácticas		Informe de aplicación de los diferentes procedimientos de análisis a casos de estudio	15,00 %
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

El estudiante, para superar esta asignatura, deberá demostrar los siguientes resultados: 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 2:	Temas 1 a 3.	<ul style="list-style-type: none"> - Clases teórico-prácticas y aplicación a diferentes casos de estudio. - El alumno deberá entregar cada día las actividades realizadas en clase. - Al final de la semana, el alumno deberá entregar las actividades evaluables correspondientes a los temas 1 y 2. 	19.50	11.00	30.50
Semana 3:	Temas 3 y 4.	<ul style="list-style-type: none"> - Clases teórico-prácticas y aplicación a diferentes casos de estudio. - El alumno deberá entregar cada día las actividades realizadas en clase. - Al final de la semana, el alumno deberá entregar las actividades evaluables correspondientes a los temas 3 y 4. 	19.50	11.00	30.50
Semana 16 a 18:	Evaluación.	<ul style="list-style-type: none"> - Preparación de la evaluación final. - Entrega de las actividades evaluables comentadas. 	2.00	12.00	14.00
Total			41.00	34.00	75.00