

Curso Académico: (2021 / 2022)

Fecha de revisión: 20/05/2021 19:34:10

Departamento asignado a la asignatura: Departamento de Estadística

Coordinador/a: CASCOS FERNANDEZ, IGNACIO

Tipo: Optativa Créditos ECTS : 3.0

Curso : 1 Cuatrimestre : 2

REQUISITOS (ASIGNATURAS O MATERIAS CUYO CONOCIMIENTO SE PRESUPONE)

Probabilidad
Inferencia Estadística

OBJETIVOS**COMPETENCIAS QUE EL ESTUDIANTE ADQUIERE CON ESTA MATERIA**

CB6 Poseer y comprender conocimientos que aporten una base u oportunidad de ser originales en el desarrollo y/o aplicación de ideas, a menudo en un contexto de investigación

CB7 Que los estudiantes sepan aplicar los conocimientos adquiridos y su capacidad de resolución de problemas en entornos nuevos o poco conocidos dentro de contextos más amplios (o multidisciplinares) relacionados con su área de estudio

CB8 Que los estudiantes sean capaces de integrar conocimientos y enfrentarse a la complejidad de formular juicios a partir de una información que, siendo incompleta o limitada, incluya reflexiones sobre las responsabilidades sociales y éticas vinculadas a la aplicación de sus conocimientos y juicios

CB9 Que los estudiantes sepan comunicar sus conclusiones y los conocimientos y razones últimas que las sustentan a públicos especializados y no especializados de un modo claro y sin ambigüedades

CB10 Que los estudiantes posean las habilidades de aprendizaje que les permitan continuar estudiando de un modo que habrá de ser en gran medida autodirigido o autónomo.

CG1 Capacidad para aplicar las técnicas de análisis y representación de la información, con el fin de poderla adaptar a problemas reales.

CG2 Capacidad para identificar el modelo estadístico más adecuado para cada problema real y saberlo aplicar para el análisis, diseño y solución del mismo.

CG3 Capacidad para obtener soluciones científicamente viables para problemas estadísticos reales complejos, tanto de manera individual como en equipo.

CG4 Capacidad para sintetizar las conclusiones obtenidas de estos análisis y presentarlas de manera clara y convincente en un entorno bilingüe (español e inglés) tanto por escrito como oralmente.

CG5 Ser capaz de generar nuevas ideas (creatividad) y de anticipar nuevas situaciones, en los contextos del análisis de datos y de la toma de decisiones.

CG6 Aplicar habilidades sociales para el trabajo en equipo y para relacionarse con otros de forma autónoma.

CG7 Aplicar las técnicas avanzadas de análisis y representación de la información, con el fin de poderla adaptar a problemas reales.

CE11 Formalizar fenómenos aleatorios y modelizarlos por medio de modelos probabilísticos.

RESULTADOS DE APRENDIZAJE QUE ADQUIERE EL ESTUDIANTE

Adquisición de conocimientos sobre: 1) variables aleatorias, probabilidad elemental y distribuciones de probabilidad; 2) desigualdades probabilísticas relevantes; 3) vectores aleatorios, distribuciones marginales y conjuntas; 4) sucesiones de variables aleatorias y conceptos de convergencia; 5) cadenas de Markov; 6) procesos de Poisson; 7) procesos en tiempo continuo; 8) métodos de simulación univariante y multivariante; 9) métodos de remuestreo no paramétricos y paramétricos.

COMPETENCIAS QUE EL ESTUDIANTE ADQUIERE CON ESTA MATERIA

- CB6 Poseer y comprender conocimientos que aporten una base u oportunidad de ser originales en el desarrollo y/o aplicación de ideas, a menudo en un contexto de investigación
- CB7 Que los estudiantes sepan aplicar los conocimientos adquiridos y su capacidad de resolución de problemas en entornos nuevos o poco conocidos dentro de contextos más amplios (o multidisciplinares) relacionados con su área de estudio
- CB8 Que los estudiantes sean capaces de integrar conocimientos y enfrentarse a la complejidad de formular juicios a partir de una información que, siendo incompleta o limitada, incluya reflexiones sobre las responsabilidades sociales y éticas vinculadas a la aplicación de sus conocimientos y juicios
- CB9 Que los estudiantes sepan comunicar sus conclusiones y los conocimientos y razones últimas que las sustentan a públicos especializados y no especializados de un modo claro y sin ambigüedades
- CB10 Que los estudiantes posean las habilidades de aprendizaje que les permitan continuar estudiando de un modo que habrá de ser en gran medida autodirigido o autónomo.
- CG1 Capacidad para aplicar las técnicas de análisis y representación de la información, con el fin de poderla adaptar a problemas reales.
- CG2 Capacidad para identificar el modelo estadístico más adecuado para cada problema real y saberlo aplicar para el análisis, diseño y solución del mismo.
- CG3 Capacidad para obtener soluciones científicamente viables para problemas estadísticos reales complejos, tanto de manera individual como en equipo.
- CG4 Capacidad para sintetizar las conclusiones obtenidas de estos análisis y presentarlas de manera clara y convincente en un entorno bilingüe (español e inglés) tanto por escrito como oralmente.
- CG5 Ser capaz de generar nuevas ideas (creatividad) y de anticipar nuevas situaciones, en los contextos del análisis de datos y de la toma de decisiones.
- CG6 Aplicar habilidades sociales para el trabajo en equipo y para relacionarse con otros de forma autónoma.
- CG7 Aplicar las técnicas avanzadas de análisis y representación de la información, con el fin de poderla adaptar a problemas reales.
- CE11 Formalizar fenómenos aleatorios y modelizarlos por medio de modelos probabilísticos.

RESULTADOS DE APRENDIZAJE QUE ADQUIERE EL ESTUDIANTE

Adquisición de conocimientos sobre: 1) variables aleatorias, probabilidad elemental y distribuciones de probabilidad; 2) desigualdades probabilísticas relevantes; 3) vectores aleatorios, distribuciones marginales y conjuntas; 4) sucesiones de variables aleatorias y conceptos de convergencia; 5) cadenas de Markov; 6) procesos de Poisson; 7) procesos en tiempo continuo; 8) métodos de simulación univariante y multivariante; 9) métodos de remuestreo no paramétricos y paramétricos.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA

1. Introducción a las técnicas Monte Carlo
2. Simulación de variables y vectores aleatorios
3. Simulación por eventos discretos
4. Técnicas de reducción de la varianza y MCMC
5. Introducción al bootstrap
6. Bootstrap para dos muestras y estructuras de datos complejas
7. Inferencia bootstrap

ACTIVIDADES FORMATIVAS, METODOLOGÍA A UTILIZAR Y RÉGIMEN DE TUTORÍAS

ACTIVIDADES FORMATIVAS DEL PLAN DE ESTUDIOS REFERIDAS A MATERIAS

- AF1 Clase teórica
- AF2 Clases prácticas
- AF4 Prácticas de laboratorio
- AF5 Tutorías
- AF6 Trabajo en grupo
- AF7 Trabajo individual del estudiante
- AF8 Pruebas de evaluación presencial

Código actividad	Nº Horas totales	Nº Horas Presenciales	% Presencialidad Estudiante
------------------	------------------	-----------------------	-----------------------------

AF1	33		33		100
AF2	15		15		100
AF4	15		15		100
AF5	12		12		100
AF6	30		0		0
AF7	115,5		0		0
AF8	4,5		4,5		100
TOTAL MATERIA		225		75	33

METODOLOGÍAS DOCENTES QUE SE UTILIZARÁN EN ESTA MATERIA

MD1 Exposiciones en clase del profesor con soporte de medios informáticos y audiovisuales, en las que se desarrollan los conceptos principales de la materia y se proporciona la bibliografía para complementar el aprendizaje de los alumnos.

MD3 Resolución de casos prácticos, problemas, etc.¿ planteados por el profesor de manera individual o en grupo

SISTEMA DE EVALUACIÓN

Peso porcentual del Examen/Prueba Final:	0
Peso porcentual del resto de la evaluación:	100

SE2 Trabajos individuales o en grupo realizados durante el curso: 100%

BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

- Bradley Efron, Robert Tibshirani An Introduction to Bootstrap, Chapman & Hall, 1998
- Sheldon Ross Simulation, Academic Press, 2013

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

- Ralf Korn, Elke Korn, Gerald Kroisandt Monte Carlo Methods and Models in Finance and Insurance, Chapman & Hall/CRC, 2010