

Curso Académico: (2023 / 2024)

Fecha de revisión: 18-04-2023

Departamento asignado a la asignatura: Departamento de Estadística

Coordinador/a: KAISER REMIRO, REGINA

Tipo: Optativa Créditos ECTS : 6.0

Curso : 4 Cuatrimestre :

REQUISITOS (ASIGNATURAS O MATERIAS CUYO CONOCIMIENTO SE PRESUPONE)

Estadística Aplicada a las CCSS 2

OBJETIVOS

Capacidad de predecir datos cuantitativos mediante análisis de series temporales.
Capacidad de relaizar regresiones logísticas.

DESCRIPCIÓN DE CONTENIDOS: PROGRAMA

1. Series Temporales. Predicción con modelos ARIMA
Características de una serie temporal: Periodicidad, tendencia, variabilidad y ciclo estacional.
Concepto de serie estacionaria
Función de autocorrelación simple y parcial
Ruido Blanco
Modelos Autorregresivos AR(p)
Modelos de media móvil MA(q)
Modelos ARMA y ARIMA
Estimación y diagnosis.
Predicción
Modelos ARIMA estacionales: identificación, estimación, diagnosis y predicción.
2. Regresión logística
Introducción al modelo Logit.
Estimación de parámetros.
Interpretación de los parámetros
Diagnosis del modelo.
3. Extensiones

ACTIVIDADES FORMATIVAS, METODOLOGÍA A UTILIZAR Y RÉGIMEN DE TUTORÍAS

Teoría (4ECTS).Clases teóricas con material de apoyo disponible vía web.
Prácticas (2ECTS) Clases en aula informática. Debates.

SISTEMA DE EVALUACIÓN

50% repartido en dos parciales.
50% examen final.

En la convocatoria extraordinaria se tomará la mejor opción entre examen (50%) y evaluación continua (50%) o solo examen final con un peso del 100%.

Peso porcentual del Examen Final:	50
Peso porcentual del resto de la evaluación:	50

BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

- Peña, D Análisis de Series temporales, Alianza, 2005