

**FITXA IDENTIFICATIVA****Dades de l'Assignatura**

Codi	36519
Nom	Predicció amb dades temporals
Cicle	Grau
Crèdits ECTS	6.0
Curs acadèmic	2024 - 2025

Titulació/titulacions

Titulació	Centre	Curs	Període
1332 - Grau en Intel·ligència i Anàlisi de Negocis/BIA	Facultat d'Economia	2	Segon quadrimestre

Matèries

Titulació	Matèria	Caràcter
1332 - Grau en Intel·ligència i Anàlisi de Negocis/BIA	24 - Eines i Tècniques d'Anàlisi de Dades	Obligatòria

Coordinació

Nom	Departament
ARRIBAS FERNANDEZ, IVAN	10 - Anàlisi Econòmica

RESUM

Predicció amb Dades Temporals és una assignatura de formació bàsica adscrita a les àrees de Mètodes Quantitatius per a l'Economia i l'Empresa i Fonaments de l'Anàlisi Econòmica que s'imparteix en el segon semestre del segon curs del Grau d'INTEL·LIGÈNCIA I ANALÍTICA DE NEGOCIS amb una càrrega lectiva total de 6 crèdits ECTS.

L'objectiu general és la formació de professionals capacitats per a aplicar els mètodes per a analitzar, descriure, avaluar i especialment efectuar previsions sobre sèries de dades que evolucionen en el temps, això és, els models de Sèries Temporals.

En particular, l'alumne haurà de donar resposta a problemes reals complexos, elaborant hipòtesis, construint models, aplicant tècniques d'anàlisi estadística i tot això amb l'objectiu últim d'elaborar prediccions i conèixer la seua qualitat com a eina d'ajuda la presa de decisions.



CONEXEMENTS PREVIS

Relació amb altres assignatures de la mateixa titulació

No heu especificat les restriccions de matrícula amb altres assignatures del pla d'estudis.

Altres tipus de requisits

L'assignatura no té pròpiament cap requeriment previ. No obstant això, s'assumeix que per a cursar aquesta assignatura amb èxit l'estudiant té un nivell de matemàtiques bàsic (els coneixements que corresponen a primer i segon de batxillerat en la branca de ciències o ciències socials) i està familiaritzat amb els continguts de les matèries "Anàlisi Exploratori de Dades" i "Atzar, Incertesa i Inferència" cursades en primer, i amb "Predicció amb Dades Transversals" cursada en el primer semestre de segon curs

COMPETÈNCIES (RD 1393/2007) // RESULTATS DE L'APRENTATGE (RD 822/2021)

1332 - Grau en Intel·ligència i Analítica de Negocis/BIA

- Que els estudiants sàpien aplicar els seus coneixements al seu treball o vocació d'una forma professional i posseïsquen les competències que solen demostrar-se per mitjà de l'elaboració i defensa d'arguments i la resolució de problemes dins de la seua àrea d'estudi.
- Que els estudiants puguen transmetre informació, idees, problemes i solucions a un públic tant especialitzat com no especialitzat.
- Que els estudiants hagen desenvolupat aquelles habilitats d'aprenentatge necessàries per a emprendre estudis posteriors amb un alt grau d'autonomia.
- Coneixement de matèries bàsiques que capacite per a l'aprenentatge de nous mètodes i tecnologies, i que li dote de versatilitat per a adaptar-se a noves situacions en els àmbits acadèmic i professional.
- Capacitat per a resoldre problemes, i per a comunicar i transmetre coneixements, habilitats i destreses, comprenent la responsabilitat ètica, igualitària i professional de l'activitat de la Intel·ligència i Analítica de Negocis.
- Capacitat per a prendre decisions de forma autònoma en entorns digitals caracteritzats per l'abundància i dinamisme de les dades..
- Conèixer i saber utilitzar adequadament els diferents mètodes quantitius i qualitius apropiats per a raonar analíticament, avaluar resultats i predir magnituds econòmiques i financeres.
- Capacitat per a aplicar mètodes analítics i matemàtics per a l'anàlisi dels problemes econòmics i empresarials.
- Capacitat d'anàlisi i síntesi.
- Capacitat d'aprenentatge autònom.



- Capacitat per a definir, resoldre i exposar de forma sistèmica problemes complexos.
- Aplicar mètodes i tècniques d'anàlisis, síntesis i representació gràfica mitjançant programes informàtics.
- Utilitzar programari per a resoldre problemes amb incertesa.
- Distingir entre els enfocaments explicatiu i predictiu en l'anàlisi de dades i en els negocis.
- Predir utilitzant programari adequat al maneig de sèries temporals.
- Aplicar, utilitzant programari, tècniques d'aprenentatge automàtic (machine learning) supervisat.

RESULTATS D'APRENTATGE (RD 1393/2007) // SENSE CONTINGUT (RD 822/2021)

- Saber aplicar diferents mètodes i tècniques d'anàlisis de dades temporals mitjançant programes informàtics.
- Conèixer i diferenciar els components d'una sèrie temporal.
- Aprendre a extraure els components de sèries temporals, a interpretar-los i a realitzar projeccions d'aquests.
- Conèixer les bases teòriques de la modelització ARIMA i la seua aplicació mitjançant programari informàtic.
- Saber realitzar prediccions de variables temporals econòmiques.
- Conèixer com incorporar les variacions de calendari en els models predictius.
- Aprendre a valorar la capacitat predictiva dels mètodes segons l'horitzó de predicció.
- Saber utilitzar el programari per a la implementació de models d'aprenentatge automàtic.
- Conèixer les potencialitats i febleses de les diferents tècniques de predicció en aprenentatge automàtic, així com, la seua aplicació a diversos problemes de negocis.
- Conèixer els problemes de la sobre-parametrització i el paper dels conjunts d'entrenament i comprovació.
- Saber resoldre problemes de negocis utilitzant metodologies d'aprenentatge automàtic.

DESCRIPCIÓ DE CONTINGUTS

1. Introducció

Tema introductor on motivarem l'assignatura, centrarem els seus objectius i delimitarem l'abast dels continguts del curs.

2. Definició i components

Tema nuclear on definirem el concepte de sèrie temporal i els seus components: tendència, cicle, estacionalitat, intervenció i residu. A més, proposarem ferramentes senzilles per a poder identificar quins components té d'una sèrie determinada i poder descriure-les adequadament. En funció de les components presents en una sèrie, aplicarem les tècniques que anem veure en els temes 4, 6, 7 i 8.



3. Mètodes de predicció

En este tema descriurem les principals tècniques de predicció que usarem en el curs: mètodes senzills, models d'allisat i models ARIMA. A més, indicarem els principals avantatges i desavantatges de cada mètode. Tindrem temps durant el curs per a aprofundir en estos mètodes.

4. Sèries sense tendència ni estacionalitat

Aplicarem les tècniques de previsió descrites en el tema 3 a les sèries més senzilles, aquelles sense tendència ni estacionalitat. A més, definirem els criteris de qualitat d'ajust i predicció que usarem durant el curs.

5. Avaluació de les prediccions

Existixen dos aproximacions diferents per a valorar les prediccions: Conjunt d'entrenament/conjunt d'ajust i Origen de predicció mòbil. En este tema les descriurem i aplicarem a diferents exemples.

6. Sèries amb tendència i sense estacionalitat

Aplicarem les tècniques de previsió descrites en el tema 3 a sèries que tenen tendència, però no tenen estacionalitat, afegint un grau de complexitat als mètodes vistos en el tema 4.

7. Sèries amb estacionalitat (primera part)

Les sèries amb estacionalitat són les més complexes d'analitzar i predir, així que dividirem el seu estudi en dos temes. En este primer tema veurem com predir-les usant els mètodes senzills i els d'allisat.

8. Sèries amb estacionalitat (segona part)

Acabem el curs aplicant els models ARIMA per a la predicció de sèries amb estacionalitat.



VOLUM DE TREBALL

ACTIVITAT	Hores	% Presencial
Pràctiques en aula informàtica	45,00	100
Classes de teoria	15,00	100
Elaboració de treballs en grup	15,00	0
Estudi i treball autònom	30,00	0
Preparació d'activitats d'avaluació	30,00	0
Preparació de classes pràctiques i de problemes	15,00	0
TOTAL	150,00	

METODOLOGIA DOCENT

El desenvolupament de l'assignatura s'estructura fonamentalment entorn de les sessions teòriques i pràctiques diferenciades, sent les teòriques d'1 hora a la setmana (25%) i les pràctiques de 3 hores a la setmana (75%). La metodologia, per tant, emfatitza els aspectes més pràctics i computacionals de l'assignatura.

- Temps de teòrica: es plantejaran conceptes nuclears de cada tema, de manera precisa i rigorosa, en llenguatge natural, gràfic i formal.
- Temps de pràctica: a partir del codi R i dels fitxers de dades proporcionats, es practican els conceptes teòrics vistos i s'aprendrà el maneig de R per a l'anàlisi de sèries temporals

Per a la correcta marxa del curs és imprescindible que els alumnes portin el seu propi portàtil per treballar tant a les classes de teoria com de pràctiques.

AVALUACIÓ

L'avaluació contínua suposarà un 80% de la nota de l'assignatura i **l'examen d'avaluació final un 20%**

- Després de la majoria dels temes es realitzarà una **prova tipus test**. La prova contindrà preguntes de resposta múltiple, numèrica, etc. Aquesta part suposarà un 40% de la nota de l'assignatura.
- Els alumnes realitzaran **treballs d'aplicació pràctica** dels conceptes vistos durant el curs. El total de feines suposarà un 40% de la nota de l'assignatura.
- Al final del curs i en les dates oficials, es farà un **examen final** que suposarà el 20% de la nota de l'assignatura.



REFERÈNCIES

Bàsiques

- Dos libros interesantes:

- * Forecasting: Principles and Practice de Rob J. Hyndman y George Athanasopoulos: <https://otexts.com/fpp2/> (existe una version fpp3 que aplica el entorno 'tidy')
- * An Introduction to Statistical Learning with Applications in R de Gareth, Witten, Hastie y Tibshirani. Springer New York 2013

Otros libros de interés:

- * Hyndman, R. J., Koehler, A., B., Ord, J. K. y Snyder, R. D. (2008) Forecasting with Exponential Smoothing: the State Space Approach. Ed. Springer.
- * Machine Learning Using R With Time Series and Industry-Based. Use Cases in R. Ramasubramanian y Singh. Apress, 2019

Libros de R y Series Temporales:

- * Cowpertwait, P. S. P. y Metcalfe, A. V. (2009) Introductory Time Series with R. Springer (Collection Use R!)
- * Pfaff, B. (2008) Analysis of Integrated and Cointegrated Time Series with R. Springer (Collection Use R!)
- * Cryer, J. D., Chan, Kung-Sik. (2008) Time Series Analysis. With Applications in R. Springer

Dos clásicos:

- * Makridakis, S. y Hibon, M. (2000). The M3-Competition: results, conclusions and implications. International Journal of Forecasting, 16(4), pp. 451-476. doi:10.1016/S0169-2070(00)00057-1
- * Box, G. E.P. y Jenkins, G. (1976). Time Series Analysis: Forecasting and Control Editado por Holden-Day, San Francisco, CA