



## FICHA TÉCNICA DE LA ASIGNATURA

Datos de la asignatura	
Nombre completo	Machine Learning II: Predicción / Machine Learning II: Forecasting
Código	E000009393
Título	<a href="#">Grado en Análisis de Negocios / Business Analytics</a>
Cuatrimestre	Semestral
Créditos	3,0 ECTS
Carácter	Obligatoria (Grado)
Departamento / Área	Departamento de Métodos Cuantitativos
Responsable	Jose Luis Arroyo Barrigüete
Horario de tutorías	Solicitar cita previa. Los horarios de tutorías estarán disponibles cuando los horarios sean definitivos
Descriptor	Machine Learning, series temporales

Datos del profesorado	
Profesor	
Nombre	José Luis Arroyo Barrigüete
Departamento / Área	Departamento de Métodos Cuantitativos
Despacho	Alberto Aguilera 23
Correo electrónico	jlarroyo@icade.comillas.edu
Teléfono	2257

## DATOS ESPECÍFICOS DE LA ASIGNATURA

Contextualización de la asignatura
<b>Aportación al perfil profesional de la titulación</b>
<p>Esta asignatura aborda un aspecto esencial del análisis de datos, como son las series temporales. Muchos de los problemas empresariales a los que se enfrentarán los estudiantes durante su carrera profesional requieren de este tipo de análisis, pues gran parte de la información necesaria para la toma de decisiones está estructurada de este modo.</p> <p>El carácter aplicado de la asignatura permite poner en práctica muchos conceptos y teorías que ya se han introducido en otras asignaturas, ya sean de tipo económico, de marketing o de finanzas.</p> <p>La obligación de tener que realizar un trabajo de aplicación empírico, supone que el alumno ha adquirido la destreza suficiente como para abordar problemas reales, similares a los que habrá de enfrentar una vez se incorpore al mercado laboral.</p>



## Prerequisitos

Fundamentos de análisis económico (micro y macro)

Fundamentos de estadística descriptiva e inferencia

Manejo intermedio de la hoja de cálculo

Programación en R

## Competencias - Objetivos

### Competencias

#### GENERALES

<b>CG02</b>	Capacidad de análisis de datos masivos procedentes de diversas fuentes: texto, audio, numérica e imagen
-------------	---

<b>CG03</b>	Resolución de problemas y toma de decisiones en un entorno de datos masivos tanto cuantitativos como cualitativos
-------------	---

	<b>RA1</b>	Saber seleccionar para cada problema la técnica o técnicas de análisis de datos más adecuada para poder convertir los datos ¿en bruto¿ en información y ésta en conocimiento que ayude a la toma de decisiones y a mejorar la gestión.
--	------------	--

<b>CG04</b>	Capacidad para elaborar proyectos e informes de manera oral y escrita, difundiendo estas ideas a través de canales digitales
-------------	--

	<b>RA1</b>	Ser capaz de resumir, sintetizar y comunicar de una forma atractiva y eficaz los resultados de la aplicación de las técnicas de análisis de datos, incluso de las más sofisticadas, de manera que resulten comprensibles a destinatarios no técnicos y ayuden de forma eficiente a la toma de decisiones empresariales.
--	------------	---

#### ESPECÍFICAS

<b>CE19</b>	Conocer los fundamentos de las principales técnicas tanto de la estadística clásica (descriptiva e inferencial) como del data mining
-------------	--

	<b>RA3</b>	Conocer los fundamentos de las principales técnicas de data mining supervisado (predictivo).
--	------------	--

<b>CE20</b>	Saber modelizar un problema empresarial real que precise análisis de datos y seleccionar críticamente la técnica o combinación de técnicas más adecuada
-------------	---

	<b>RA2</b>	Saber modelizar un problema de predicción (regresión, clasificación)
		Conocer las ventajas y limitaciones de los procedimientos de data mining y saber



	<b>RA4</b>	Conocer los ventajas y limitaciones de los procedimientos de data mining, saber cómo enfocar un problema desde diferentes técnicas complementarias
<b>CE21</b>		Saber interpretar, evaluar y comunicar resultados derivados de las técnicas de análisis de datos así como usarlos para la ayuda en la gestión y la toma de decisiones empresariales
	<b>RA2</b>	Saber interpretar, evaluar y comunicar los resultados derivados de un análisis que emplee técnicas de data mining predictivo.
<b>CE22</b>		Saber aplicar las técnicas de análisis de datos (tanto las de la estadística clásica como las técnicas de data mining) a un conjunto de datos reales, mediante el empleo de algún software apropiado para tal fin
	<b>RA3</b>	Saber aplicar técnicas de data mining predictivo (aprendizaje supervisado) a un conjunto de datos reales usando software apropiado para tal fin
<b>CEO23</b>		Capacidad de utilizar modelos teóricos sobre la formación de los precios de activos financieros para diseñar estrategias de inversión automáticas

## BLOQUES TEMÁTICOS Y CONTENIDOS

### Contenidos – Bloques Temáticos

#### Tema 1: Introducción a las series temporales

Concepto de serie temporal

Descomposición de series temporales

#### Tema 2: Suavizado de series temporales

Tipos de suavizado

Suavizado de series sin tendencia ni estacionalidad

Suavizado de series con tendencia y sin estacionalidad

Suavizado de series con tendencia y estacionalidad

#### Tema 3: procesos AR(p)

Concepto de proceso autorregresivo

Función de Autocorrelación Simple (FAS)

Función de Autocorrelación Parcial (FAP)

Identificación de procesos AR



Predicción

### **Tema 4: Procesos MA(q)**

Concepto de proceso de media móvil

FAS y FAP en procesos MA

Predicción

### **Tema 5: Procesos ARMA(p,q) y ARIMA(p,d,q)**

Procesos ARMA(p,q)

Procesos integrados ARIMA(p,d,q)

Estacionalidad: procesos ARIMA(P,D,Q)<sub>s</sub> x (p,d,q)

Predicción

### **Tema 6: Volatilidad: modelos ARCH y GARCH**

Concepto de volatilidad

Modelos ARCH

Modelos GARCH

### **tema 7: Otros modelos avanzados: RNA, KNN, clustering**

Redes Neuronales Artificiales (RNA)

k-Nearest Neighbors (KNN)

Clustering

## **METODOLOGÍA DOCENTE**

### **Aspectos metodológicos generales de la asignatura**

La metodología es variada combinando actividades presenciales como no presenciales, individuales y en grupo (parejas), conceptuales y de aplicación práctica empleando datos y aplicaciones informáticas

### **Metodología Presencial: Actividades**

Exposición magistral del marco general de cada tema

Realización y discusión de ejemplos introductorios de aplicación práctica

Tutorización general de los trabajos de aplicación práctica

CG02, CG03,  
CG04, CE19,  
CE20, CE21, CE22



Introducción al empleo de R para el análisis de series temporales	CE20, CE21, CE22, CEO23
Realización de una o dos pruebas intermedias	
Realización del examen final de la asignatura	

### Metodología No presencial: Actividades

Realización de prácticas en R ("Homeworks")	CG02, CG03, CG04, CE19, CE20, CE21, CE22, CEO23
Realización del trabajo final de aplicación empírica (propuesta + entrega final)	
Preparación de las pruebas	
Estudio y preparación del examen final	

## RESUMEN HORAS DE TRABAJO DEL ALUMNO

HORAS PRESENCIALES		
Lecciones de Carácter expositivo	Ejercicios y resolución de casos y de problemas	
15.00	15.00	
HORAS NO PRESENCIALES		
Ejercicios y resolución de casos y de problemas	Estudios individual y/o en grupo, y lectura organizada	Trabajos monográficos y de investigación, individuales o colectivos
20.00	20.00	10.00
<b>CRÉDITOS ECTS: 3,0 (80,00 horas)</b>		

## EVALUACIÓN Y CRITERIOS DE CALIFICACIÓN

Actividades de evaluación	Criterios de evaluación	Peso
Examen final	Calificación del 0 al 10	50
Trabajo escrito final de aplicación empírica, que adicionalmente se defenderá de forma oral en clase.	Imprescindible realizarlo con un mínimo de calidad para poder aprobar la asignatura en convocatoria ordinaria y extraordinaria	20
Pruebas intermedias y otros items de evaluación continua (prácticas semanales, kahoots, etc)	Calificación de 0 a 10	30



## Calificaciones

Es requisito imprescindible para aprobar la asignatura en cualquiera de las convocatorias que el examen obtenga una calificación superior a 4.5 puntos (en una escala de 0 a 10 puntos)

Respecto al trabajo de aplicación empírica, el profesor podrá realizar preguntas orales sobre el mismo si lo estima conveniente.

Alumnos en Convocatoria Extraordinaria (2ª): se seguirá el mismo sistema de calificación que para la convocatoria ordinaria (se ponderan todos los componentes de evaluación continua realizados durante el curso). El alumno que no haya realizado o que haya suspendido el trabajo práctico deberá realizarlo nuevamente para esta convocatoria. Subyace la filosofía de que la convocatoria extraordinaria no puede ser una vía para no realizar el trabajo de aplicación empírica.

Alumnos de intercambio (OUT) y resto de convocatorias: Se recomienda realizar el trabajo de aplicación empírica como forma de entender mejor la asignatura. La calificación final será la mejor de las siguientes dos opciones: a) 100% examen b) 80% examen y 20% trabajo. En el caso de alumnos de 3ª y posteriores convocatorias, ha de ser un trabajo nuevo, con un tema distinto al entregado en la 1ª/2ª convocatoria.

Alumnos con dispensa de escolaridad y situaciones excepcionales: se atenderá caso a caso, buscando equilibrio entre equidad y objetivos de aprendizaje.

## PLAN DE TRABAJO Y CRONOGRAMA

Actividades	Fecha de realización	Fecha de entrega
Prueba 1	Al finalizar el tema 3	Al finalizar el tema 3
Prueba 2	Al finalizar el tema 5	Al finalizar el tema 5
Presentación oral del trabajo final, y entrega de la versión escrita	Al finalizar el tema 7	Al finalizar el tema 7

## BIBLIOGRAFÍA Y RECURSOS

### Bibliografía Básica

Apuntes de la asignatura entregados por el profesor a través de Moodle

Hyndman, R. J., & Athanasopoulos, G. (2014). *Forecasting: principles and practice*, 2013. URL: <https://www.otexts.org/fpp>

Peña, D. (2005). *Análisis de series temporales*. Alianza.

### Bibliografía Complementaria



# COMILLAS

UNIVERSIDAD PONTIFICIA

ICAI

ICADE

CIHS

**GUÍA DOCENTE  
2018 - 2019**

Shmueli, G., Bruce, P. C., Yahav, I., Patel, N. R., & Lichtendahl Jr, K. C. (2017). *Data mining for business analytics: concepts, techniques, and applications in R*. John Wiley & Sons.

En cumplimiento de la normativa vigente en materia de **protección de datos de carácter personal**, le informamos y recordamos que puede consultar los aspectos relativos a privacidad y protección de datos [que ha aceptado en su matrícula](#) entrando en esta web y pulsando "descargar"

[https://servicios.upcomillas.es/sedelectronica/inicio.aspx?csv=02E4557CAA66F4A81663AD10CED66792](https://servicios.upcomillas.es/sedeelectronica/inicio.aspx?csv=02E4557CAA66F4A81663AD10CED66792)