



GRADO EN ESTADÍSTICA
PROPUESTA DE TEMA PARA TRABAJOS FIN DE GRADO
CURSO ACADÉMICO 2018/2019

Título del trabajo:Segmentación, caracterización estadística y análisis basado en distancias de series temporales financieras

Tutor/a:Carlos Javier Mantas Ruiz

Cotutor/a:

Departamento responsable:Ciencias de la Computación e Inteligencia Artificial

Perfil y número de estudiantes al que va dirigido (máximo 2):2

(Rellenar sólo en caso de que la propuesta esté realizada a través de estudiante)

Estudiante que propone el trabajo (Nombre, Apellidos, DNI):

Tipo de trabajo *(consultar (*))*:6

Competencias*(estas son la mínimas; consultar (**) si se considera añadir otras)*

Competencias generales: G02, G03, G04, G05, G06, G07, G08, G09.

Competencias específicas: E01, E02, E03, E04, E05, E08, E09, E10.

Resultados de aprendizaje *(estos son los mínimos; añadir otros si se considera)*

- Adquirir competencias globales ligadas al desarrollo y aplicación de los conocimientos del Grado.
- Adquirir competencias ligadas a la búsqueda y organización de información y documentación relevante sobre el tema objeto de estudio.
- Aplicar el “pensamiento estadístico” y tener capacidad para enfrentarse a las distintas etapas de un estudio estadístico (desde el planteamiento del problema hasta la exposición de resultados).
- Saber presentar, de forma escrita y oral, la memoria, los resultados y las conclusiones del trabajo realizado.

Antecedentes y resumen del tema propuesto:

El trabajo fin de grado propuesto consistiría en los siguientes pasos:

- 1) Estudio, análisis e implementación de algoritmos de segmentación sobre series temporales financieras.
- 2) Caracterización estadística de cada uno de los segmentos obtenidos. Estudio y análisis.
- 3) Análisis, diseño e implementación de algoritmos de clustering y clasificadores basados en distancias.
- 4) Aplicación de los algoritmos y clasificadores del paso 3 sobre los segmentos obtenidos en el paso 1.



GRADO EN ESTADÍSTICA
PROPUESTA DE TEMA PARA TRABAJOS FIN DE GRADO
CURSO ACADÉMICO 2018/2019

Breve descripción de las actividades presenciales y no presenciales a realizar:

Actividades presenciales (15-30%)	Planteamiento, orientación y supervisión	45
Exposición del trabajo	45	
Otras:		
Actividades no presenciales (70-85%)	Preparación del trabajo	150
Elaboración de la memoria	60	
Otras:		
Total (12 ECTS)		

Objetivos que se pretenden alcanzar:

-) Familiarizar al alumno con un problema de análisis de series temporales real.
-) Estudio detallado del comportamiento repetitivo de las series temporales financieras.
-) Combinación de técnicas de aprendizaje automático y medidas de caracterización estadísticas para la resolución de un problema real.

Bibliografía básica para la puesta en marcha del trabajo:

-) Fu, T. C.: "A review on time series data mining", Eng. Appl. Artif. Intell. 2 (1) 164-181 (2011).
-) Wong, J., Lian, H., Cheong, S. "Detecting macroeconomic phases in the down jones industrial average time series", Physica A 388(21), 4635-4645 (2009).
-) Sato, A.H., "A comprehensive analysis of time series segmentation on Japanese stock prices", Procedia Computer Science 24, 307-314 (2013); 17th Asia Pacific Symposium on Intelligent and Evolutionary systems, IES 2013.

Tipo de trabajo (*):

1. Estudio de profundización en algún tema concreto de Estadística, o como proyecto de aplicación de la misma a estudios o problemas de otros ámbitos científicos o sociales.
2. Realización completa de todas las fases de un proyecto estadístico, bien con auxilio de prácticas en empresas o con prácticas propuestas y dirigidas por el tutor.
3. Estudio de casos, teóricos o prácticos, relacionados con la Estadística.
4. Elaboración de un informe o un proyecto de naturaleza profesional.
5. Elaboración de un plan de empresa.
6. Simulación de encargos profesionales.
7. Trabajos bibliográficos sobre el estado actual de una temática relacionada con la Estadística.
8. Creación y/o empleo de herramientas informáticas para su uso en Estadística.
9. Trabajos de inicio a la investigación.



**GRADO EN ESTADÍSTICA
PROPUESTA DE TEMA PARA TRABAJOS FIN DE GRADO
CURSO ACADÉMICO 2018/2019**

10. Trabajos cuya finalidad sea la divulgación de la Estadística en diversos contextos.
11. Trabajos sobre Historia de la Estadística.
12. Trabajos relacionados con la docencia de la Estadística.

Competencias ()**

Competencias generales:

G01. Poseer los conocimientos básicos de los distintos módulos que, partiendo de la base de la educación secundaria general, y apoyándose en libros de texto avanzados, se desarrollan en la propuesta de título de Grado en Estadística que se presenta.

G02. Saber aplicar los conocimientos básicos de cada módulo a su trabajo o vocación de una forma profesional y poseer las competencias que suelen demostrarse por medio de la elaboración y defensa de argumentos y la resolución de problemas dentro de la Estadística y ámbitos en que esta se aplica directamente.

G03. Saber reunir e interpretar datos relevantes para emitir juicios que incluyan una reflexión sobre temas relevantes de índole social, científica o ética.

G04. Poder transmitir información, ideas, problemas y sus soluciones, de forma escrita u oral, a un público tanto especializado como no especializado.

G05. Haber desarrollado aquellas habilidades de aprendizaje necesarias para emprender estudios posteriores con un alto grado de autonomía.

G06. Saber utilizar herramientas de búsqueda de recursos bibliográficos.

G07. Poder comunicarse en otra lengua de relevancia en el ámbito científico.

G08. Poseer habilidades y aptitudes que favorezcan el espíritu emprendedor en el ámbito de aplicación y desarrollo de su formación académica.

G09. Fomentar y garantizar el respeto a los Derechos Humanos, a los principios de accesibilidad universal, igualdad, y no discriminación; y los valores democráticos, de la cultura de la paz y de igualdad de género.

Competencias específicas:

E01. Conocer los fundamentos básicos del razonamiento estadístico, en el diseño de estudios, en la recogida de información, en el análisis de datos y en la extracción de conclusiones.

E02. Conocer, saber seleccionar y saber aplicar, técnicas de adquisición de datos para su tratamiento estadístico.

E03. Conocer los fundamentos teóricos y saber aplicar modelos y técnicas estadísticas en estudios y problemas reales en diversos ámbitos científicos y sociales.



**UNIVERSIDAD
DE GRANADA**

**GRADO EN ESTADÍSTICA
PROPUESTA DE TEMA PARA TRABAJOS FIN DE GRADO
CURSO ACADÉMICO 2018/2019**

E04. Saber seleccionar los modelos o técnicas estadísticas para su aplicación en estudios y problemas reales en diversos ámbitos científicos y sociales, así como conocer herramientas de validación de los mismos.

E05. Comprender la importancia de la Investigación Operativa como metodología de optimización, toma de decisiones y diseño de modelos particulares para la resolución de problemas en situaciones específicas.

E06. Comprender y utilizar básicamente el lenguaje matemático.

E07. Conocer los conceptos y herramientas matemáticas necesarias para el estudio de los aspectos teóricos y prácticos de la Probabilidad, la Estadística y la Investigación Operativa.

E08. Conocer y saber utilizar aplicaciones informáticas de análisis estadístico, cálculo numérico y simbólico, bases de datos, visualización gráfica y optimización, que sean útiles para la aplicación y desarrollo de las técnicas estadísticas.

E09. Conocer los conceptos básicos y habilidades propias de un ámbito científico o social en el que la Estadística o la Investigación operativa sean una herramienta fundamental.

E10. Tomar conciencia de la necesidad de asumir las normas de ética profesional y las relativas a la protección de datos y del secreto estadístico, como premisas que deben guiar la actividad profesional como profesionales de la Estadística.