

Nombre de la asignatura	SERIES DE TIEMPO
Asesor	Jesús Manuel García Ramos
Presentación del asesor	Mi nombre es Jesús Manuel García Ramos, soy doctor en economía con posdoctorado en Cadenas de Valor Agregado. Pertenezco al Sistema Nacional de Investigadores; mis líneas de investigación son: Ciclos Económicos y Sincronización Cíclica, Análisis de Sistemas Complejos, Análisis de Redes Sociales y Económicas, y Economía del Arte. A lo largo de diez años he impartido más de cuarenta cursos a nivel doctorado, maestría, especialidad, diplomado y licenciatura; entre algunos se encuentran: Análisis de Sistemas Complejos, Análisis de Series de Tiempo, Econometría y Álgebra Lineal. En el 2017 obtuve el Premio Internacional de Investigación Emilio Fontela, otorgado por la Sociedad Hispanoamericana de análisis Input-Output; y en el 2016, el primer lugar en el Premio Internacional de Documentos de Trabajo, otorgado por el Banco Central de Bolivia y la Asociación de Pensamiento Económico Latinoamericano. En términos artísticos, bajo el seudónimo de Manuel Sauceverde, he obtenido once premios literarios y formo parte del Ensamble Didar: Música Tradicional de Irán. De corazón, creo que todo científico tiene alma de artista y viceversa.
Semestre	Sexto
Requisito	Cálculo Diferencial Multivariado y Álgebra Lineal e Introducción a la Econometría
Objetivo general de la asignatura	Al finalizar el curso, el alumno explicará, a través de una teoría económica, los resultados de modelos econométricos a nivel microeconómico y macroeconómico para determinar los alcances y limitaciones del mismo.
Contenido	UNIDAD I ANÁLISIS DE SERIES DE TIEMPO I.1 Método de dominio de tiempo I.2 Series de tiempo estacionarias y no estacionarias I.3 Pruebas de raíces unitarias I.3.1 Dickey-Fuller y Dickey-Fuller aumentada I.3.2 Phillips-Perron I.3.3 Cambio estructural I.4 Estimación de los modelos AR, MA y ARMA I.5 Significación de los coeficientes en los modelos de series de tiempo UNIDAD II AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y COINTEGRACIÓN II.1 El enfoque Box-Jenkins

- II.2 La regresión cointegradora
- II.3 Modelos de cointegración y de correlación de errores
- II.4 Pruebas de cointegración
- II.5 Cointegración y pruebas REH y MEX
- II.6 Problemas con los modelos VAR
- II.7 Volatilidad
 - II.7.1 Procesos ARCH y GARCH

Metodología de trabajo

Se utilizará una bibliografía mínima, que se complementará con otra que se vaya requiriendo durante el desarrollo del curso. Abriré una carpeta en Dropbox para depositar los diferentes documentos que crea pertinentes. Se requiere que el alumno posea un nivel aceptable de comprensión del inglés y conozca los comandos básicos de EViews.

Reglamento interno

1. Conducta adecuada dentro del salón de clases.
2. No se permite ingerir alimentos ni bebidas dentro del salón de clases.
3. No se pueden ocupar dispositivos móviles (celulares, tabletas, etc.) de clases.
4. Compartir dudas y conocimientos.
5. Tolerancia y respeto para todos los integrantes del curso.
6. El plagio (copiar y pegar información sin referencia) será castigado severamente.
7. Tolerancia de cinco minutos para tener asistencia, de lo contrario será falta.

Criterios de evaluación

Las actividades del curso deben ser trabajos originales y no se traten de una copia de internet. Si utilizan texto de otra fuente, deberán citarla. En caso de detectar plagio, se anulará la actividad. La escala de calificación será de 0 a 10. Para tener derecho a calificación y acreditar la asignatura, deberán cubrir el 80% de asistencia y entregar todas las actividades (tareas y participación en clase). La evaluación consistirá en:

- Dos exámenes parciales (60%)
- Tareas y participación en clase (20%)
- Trabajo final (20%)

Referencias

Bibliografía básica *f*

- Enders, W. (1995), Applied Econometric Time Series, John Wiley, New York.
- Guerrero, V. (1991), Análisis estadístico de las series de tiempo económicas, UAM, México.

Bibliografía complementaria *f*

- Gujarati, D (2006), Econometría, Madrid, McGraw Hill.
- Maddala, G.S. (1994), Econometría, México, McGraw-Hill.
- Pindyk, R. (1998), Econometric Models and Economic Forecast, Boston, McGrawHill

Dosificación Modalidad Abierta 2019-II



Semana	Fecha	Contenido temático	Lectura obligatoria	Actividad de aprendizaje							
				Actividad a desarrollar	Formato de entrega	Fecha y hora de solicitud	Fecha y hora de entrega	Fecha de entrega de calificación y observaciones	Criterios de evaluación	Porcentaje de la evaluación	
1	2 de febrero	UNIDAD I. ANÁLISIS DE SERIES DE TIEMPO I.1 Método de dominio de tiempo.	Ángel Alcalde, Econometría: Modelos Deterministas y Estocásticos, México, Centro De Estudios Ramón Areces, 2002	Conocer el Análisis de Procesos Estocástico en el Domino del Tiempo							
2	9 de febrero	I.2 Series de tiempo estacionarias y no estacionarias.	Robert Pindyck, Econometría: Modelos y Pronósticos, México, McGraw Hill, 2001	Conocer las características de los procesos estocásticos estacionarios y no estacionarios Tarea 1	Plataforma, archivo pdf con tu nombre	9 de febrero a las 00:05	16 de febrero a las 23:55	23 de febrero a las 00:05	1. Claridad en la respuesta de la pregunta de investigación. 2. Uso de referencias bibliográficas (No plagios). 3. Uso de instrumental teórico económico y matemático-estadístico. 4. Ortografía y redacción.	5%	
3	16 de febrero	I.3 Pruebas de raíces unitarias. I.3.1 Dickey-Fuller y Dickey-Fuller aumentada. I.3.2 Phillips-Perron. I.3.3 Cambio estructural.	Robert Pindyck, Econometría: Modelos y Pronósticos, México, McGraw Hill, 2001	Conocer las pruebas de raíces unitarias							
4	23 de febrero	I.4 Estimación de los modelos AR, MA y ARMA.	Michael Intriligator, Modelos Econométricos: Técnicas y Aplicaciones, México, Fondo de Cultura Económica, 1996.	Conocer los modelos ARMA Tarea 2	Plataforma, archivo pdf con tu nombre	23 de febrero a las 00:05	2 de marzo a las 23:55	9 de marzo a las 00:05	1. Claridad en la respuesta de la pregunta de investigación. 2. Uso de referencias bibliográficas (No plagios). 3. Uso de instrumental teórico económico y matemático-estadístico. 4. Ortografía y redacción.	5%	

Dosificación Modalidad Abierta 2019-II



Semana	Fecha	Contenido temático	Lectura obligatoria	Actividad de aprendizaje						
				Actividad a desarrollar	Formato de entrega	Fecha y hora de solicitud	Fecha y hora de entrega	Fecha de entrega de calificación y observaciones	Criterios de evaluación	Porcentaje de la evaluación
5	2 de marzo	I.5 Significación de los coeficientes en los modelos de series de tiempo.	Michael Intriligator, Modelos Econométricos: Técnicas y Aplicaciones, México, Fondo de Cultura Económica, 1996.	Interpretar los parámetros estimados de un modelo econométrico						
6	9 de marzo	Ejercicios	Ursicino Carrascal Arranz, Análisis Econométrico con Eviews, México, Alfaomega, 2005.	Ejercicios Tarea 3	PLATAFORMA, ARCHIVO PDF CON TU NOMBRE	9 de marzo a las 00:05	16 de marzo a las 23:55	23 de marzo a las 00:05	1. Claridad en la respuesta de la pregunta de investigación. 2. Uso de referencias bibliográficas (No plagios). 3. Uso de instrumental teórico económico y matemático-estadístico. 4. Ortografía y redacción.	5%
7	16 de marzo	Repaso de unidad I			Repaso					
8	23 de marzo	Primer examen parcial			Evaluación	23 de marzo horario de clase	23 de marzo horario de clase	25 de marzo		30%
9	30 de marzo	UNIDAD II. AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y COINTEGRACIÓN II.1 EL enfoque Box-Jenkins. II.2 La regresión cointegradora.	Ángel Alcalde, Econometría: Modelos Deterministas y Estocásticos, México, Centro De Estudios Ramón Areces, 2002.	Conocer los modelos ARIMA						

Dosificación Modalidad Abierta 2019-II



Semana	Fecha	Contenido temático	Lectura obligatoria	Actividad de aprendizaje						
				Actividad a desarrollar	Formato de entrega	Fecha y hora de solicitud	Fecha y hora de entrega	Fecha de entrega de calificación y observaciones	Criterios de evaluación	Porcentaje de la evaluación
10	6 de abril	II.3 Modelos de cointegración y de correlación de errores.	Ángel Alcalde, Econometría: Modelos Deterministas y Estocásticos, México, Centro De Estudios Ramón Areces, 2002.	Conocer el concepto de cointegración Tarea 4	Plataforma, archivo pdf con tu nombre	6 de abril a las 00:05	13 de abril a las 23:55	27 de abril a las 00:05	1. Claridad en la respuesta de la pregunta de investigación. 2. Uso de referencias bibliográficas (No plagios). 3. Uso de instrumental teórico económico y matemático-estadístico. 4. Ortografía y redacción.	5%
11	13 de abril	II.5 Cointegración y pruebas REH y MEX. II.6 Problemas con los modelos VAR.	Ángel Alcalde, Econometría: Modelos Deterministas y Estocásticos, México, Centro De Estudios Ramón Areces, 2002.	Conocer los modelos VAR						
12	27 de abril	II.7 Volatilidad. II.7.1 Procesos ARCH y GARCH	Robert Pindyck, Econometría: Modelos y Pronósticos, México, McGraw Hill, 2001	Conocer los modelos ARCH y GARCH Tarea 5	Plataforma, archivo pdf con tu nombre	27 de abril a las 00:05	4 mayo a las 23:55	11 de mayo a las 00:05	1. Claridad en la respuesta de la pregunta de investigación. 2. Uso de referencias bibliográficas (No plagios). 3. Uso de instrumental teórico económico y matemático-estadístico. 4. Ortografía y redacción.	5%
13	4 de mayo	Ejercicios I	Ursicino Carrascal Arranz, Análisis Econométrico con Eviews, México, Alfaomega, 2005.	Ejercicios						
14	11 de mayo	Segundo examen parcial		Evaluación		11 de mayo Horario de clase	11 de mayo horario de clase	13 de mayo		30%