

| | |
|--|---|
| Nombre de la asignatura | SERIES DE TIEMPO |
| Asesor | Lizbeth Contreras Figueroa |
| Presentación del asesor | Mi nombre es Lizbeth Contreras Figueroa. Soy Licenciada en Economía, Especialista en Teoría Económica y Maestra en Economía Aplicada por la Facultad de Economía de la UNAM. Cuento con dos diplomados: Políticas Públicas Pro-Equidad de Género por la FLACSO, y Modelos Econométricos Dinámicos por el ITAM. Actualmente estoy estudiando la Maestría en Ciencia de Datos en el ITAM. |
| 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 | <p>UNIDAD I ANÁLISIS DE SERIES DE TIEMPO</p> <ul style="list-style-type: none">I.1 Método de dominio de tiempoI.2 Series de tiempo estacionarias y no estacionariasI.3 Pruebas de raíces unitarias<ul style="list-style-type: none">I.3.1 Dickey-Fuller y Dickey-Fuller aumentadaI.3.2 Phillips-PerronI.3.3 Cambio estructuralI.4 Estimación de los modelos AR, MA y ARMAI.5 Significación de los coeficientes en los modelos de series de tiempo <p>UNIDAD II AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y COINTEGRACIÓN</p> <ul style="list-style-type: none">II.1 El enfoque Box-JenkinsII.2 La regresión cointegradoraII.3 Modelos de cointegración y de correlación de erroresII.4 Pruebas de cointegraciónII.5 Cointegración y pruebas REH y MEXII.6 Problemas con los modelos VARII.7 Volatilidad<ul style="list-style-type: none">II.7.1 Procesos ARCH y GARCH |

Dosificación Modalidad a Distancia



Metodología de trabajo

Ingreso a la plataforma: Es responsabilidad de cada participante ingresar por lo menos dos veces a la semana al aula virtual, para conocer las novedades del curso, revisar las clases y actividades de aprendizaje; para tomar nota de las tareas a realizar y sus respectivos plazos de entrega.

Dudas: Es importante que el alumno recuerde que al estar en un sistema a distancia la fecha y hora en la que acceden todos los integrantes del grupo no necesariamente es la misma; por tanto, antes de realizar una nueva entrada en los foros de las unidades cada alumno debe revisar las publicaciones de sus demás compañeros para saber si esa duda no ha sido resuelta con anterioridad. También se pide que en el título de la entrada se ponga en forma de pregunta sintetizada. Mi retroalimentación se verá reflejada en menos de 7 días naturales. Si es una duda urgente (debido a los tiempos de entrega) les solicito que me envíen un correo electrónico a la dirección lizabethcf@economia.unam.mx

Envío de correo electrónico: Todos los correos electrónicos referentes al curso tendrán que enviarse por correo electrónico a la dirección lizabethcf@economia.unam.mx, es obligatorio que en el asunto se incluya la siguiente leyenda “**Series2020-1**”. En caso de no contar con las especificaciones anteriores el correo electrónico será descartado automáticamente y no se leerá.

Sobre la planeación: Cada unidad tendrá una breve introducción y una planeación donde se especifican las fechas de entrega.

Entregas extemporáneas: No se aceptarán entregas extemporáneas.

Slack: Una de las formas más eficientes que he encontrado para que estemos comunicados en tiempo real es mediante la aplicación Slack, es algo muy sencillo, parecido a WhatsApp, solamente que se organiza por canales. Por tal motivo les solicito que en su presentación agreguen un correo electrónico para que les envíe la invitación al *team* del grupo. Es importante señalar que por Slack les estaré recordando las fechas de entrega y brindando algunos tips para la resolución de las actividades. El canal para estar en contacto será **#series2020-2**

Reglamento interno

Recuerden que se comunica con seres humanos, pero solo utiliza palabras escritas, por lo que debe cuidar que siempre sea cortés al escribir y nunca ofender.

Interactúen con sus compañeros. Compartan sus conocimientos.

Criterios de evaluación

La escala de evaluación será de 0 a 10.

Trabajos donde exista plagio (copiar y pegar información sin referencia) serán anulados.

Dosificación Modalidad a Distancia



El porcentaje por cada actividad se menciona en el cuadro de abajo en la columna “Porcentaje de evaluación”.

Cabe destacar que no hay posibilidad de realizar examen final y no se admitirán actividades extemporáneas.

Referencias: Se señalarán en la plataforma

Dosificación Modalidad a Distancia



| Sesión | Periodo de realización de actividad sugerido | Contenido temático | Lectura obligatoria | Actividad de aprendizaje | | | | | | | |
|--------|--|---|---|--|---|---------------------------|---------------------------|--------------------------------|--|-----------------------------------|--|
| | | | | Actividad a desarrollar | Formato de entrega | Fecha y hora de solicitud | Fecha sugerida de entrega | Fecha y hora límite de entrega | Fecha de entrega de calificación y observaciones | Criterios de evaluación | Porcentaje de la evaluación |
| 1 - 13 | 27 enero – 27 mayo | | En cada actividad se señalarán las lecturas a realizar. | Trabajo final | Indicado en plataforma | 27 enero 00:00:00 | 20 mayo 10:00:00 | 20 de May 23:55 | 27 mayo | Lista de cotejo | 20% |
| | 27 enero – 27 mayo | | | Actividades extra | Cuestionario de opción múltiple en plataforma | 27 enero 00:00:00 | 24 mayo 23:55:00 | 24 de May de 2020 23:59 | 27 mayo | Elección de la respuesta correcta | En cada actividad se mostrará el puntaje extra a obtener en escala 100 |
| 1 | 27 enero – 2 febrero | UNIDAD I. ANÁLISIS DE SERIES DE TIEMPO | En cada actividad se señalarán las lecturas a realizar. | Presentación | Foro | 27 enero 00:00:00 | 9 febrero 23:55:00 | 17 febrero 23:55:00 | 25 febrero | - | - |
| 2 | 3 - 9 febrero | | | Actividad 1: Cuadro de resumen U1 Temas 1.1, 1.2 y 1.3 | Archivo PDF | 27 enero 00:00:00 | 9 febrero 23:55:00 | 13 de April de 23:55 | 25 febrero | Lista de cotejo | 5% |
| 3 | 10 - 16 febrero | | | Actividad 2: Producto U1 Temas 1.1, 1.2 y 1.3 | Archivo PDF | 27 enero 00:00:00 | 9 febrero 23:55:00 | 13 de April de 23:55 | 25 febrero | Lista de cotejo | 5% |
| | | | | Actividad 3: Reforzamiento U1 Temas 1.1, 1.2 y 1.3 | Cuestionario de opción múltiple en plataforma | 10 febrero 00:00:00 | 1 marzo 23:55:00 | 24 de May de 2020 23:59 | 18 marzo | Elección de la respuesta correcta | 10% |
| 4 | 17 - 23 febrero | | | Actividad 4: Cuadro de resumen U1 Temas 1.4 y 1.5 | Archivo PDF | 10 febrero 00:00:00 | 1 marzo 23:55:00 | 13 de April de 23:55 | 18 marzo | Lista de cotejo | 5% |
| 5 | 24 febrero - 1 marzo | | | Actividad 5: Producto U1 Temas 1.4 y 1.5 | Archivo PDF | 10 febrero 00:00:00 | 1 marzo 23:55:00 | 13 de April de 23:55 | 18 marzo | Lista de cotejo | 5% |

Dosificación Modalidad a Distancia



| Sesión | Periodo de realización de actividad sugerido | Contenido temático | Lectura obligatoria | Actividad de aprendizaje | | | | | | | |
|---|--|---|---|---|---|---------------------------|---------------------------|--------------------------------|--|-----------------------------------|-----------------------------|
| | | | | Actividad a desarrollar | Formato de entrega | Fecha y hora de solicitud | Fecha sugerida de entrega | Fecha y hora límite de entrega | Fecha de entrega de calificación y observaciones | Criterios de evaluación | Porcentaje de la evaluación |
| 6 | 2 - 8 marzo | | | Actividad 6: Reforzamiento U1 Temas 1.4 y 1.5 | Cuestionario de opción múltiple en plataforma | 2 marzo 00:00:00 | 22 marzo 23:55:00 | 24 de May de 2020 23:59 | 08 abril | Elección de la respuesta correcta | 10% |
| 7 | 9 - 15 marzo | UNIDAD II. AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y COINTEGRACIÓN | En cada actividad se señalarán las lecturas a realizar. | Actividad 7: Cuadro de resumen U2 Temas 2.1, 2.2, 2.3 y 2.4 | Archivo PDF | 2 marzo 00:00:00 | 22 marzo 23:55:00 | 13 de April de 23:55 | 08 abril | Lista de cotejo | 5% |
| 8 | 16 - 22 marzo | | | Actividad 8: Producto U2 Temas 2.1, 2.2, 2.3 y 2.4 | Archivo PDF | 2 marzo 00:00:00 | 22 marzo 23:55:00 | 13 de April de 23:55 | 08 abril | Lista de cotejo | 5% |
| 9 | 23 - 29 marzo | | | Actividad 9: Reforzamiento U2 Temas 2.1, 2.2, 2.3 y 2.4 | Cuestionario de opción múltiple en plataforma | 23 marzo 00:00:00 | 19 abril 23:55:00 | 24 de May de 2020 23:59 | 13 mayo | Elección de la respuesta correcta | 10% |
| 10 | 30 marzo - 5 abril | | | Actividad 10: Cuadro de resumen U2 Temas 2.5, 2.6 y 2.7 | Archivo PDF | 23 marzo 00:00:00 | 19 abril 23:55:00 | 20 de May 23:55 | 13 mayo | Lista de cotejo | 5% |
| 6 - 12 abril Semana de asueto | | | | | | | | | | | |
| 11 | 13 - 19 abril | UNIDAD II. AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y COINTEGRACIÓN | En cada actividad se señalarán las lecturas a realizar. | Actividad 11: Producto U2 Temas 2.5, 2.6 y 2.7 | Archivo PDF | 23 marzo 00:00:00 | 19 abril 23:55:00 | 20 de May 23:55 | 13 mayo | Lista de cotejo | 5% |
| 12 | 20 - 26 abril | | | Actividad 12: Reforzamiento U2 Temas 2.5, 2.6 y 2.7 | Cuestionario de opción múltiple en plataforma | 20 abril 00:00:00 | 10 mayo 23:55:00 | 24 de May de 2020 23:59 | 26 mayo | Elección de la respuesta correcta | 5% |

Dosificación Modalidad a Distancia



| Sesión | Periodo de realización de actividad sugerido | Contenido temático | Lectura obligatoria | Actividad de aprendizaje | | | | | | | |
|--------|--|--------------------|--|---|---|---------------------------|---------------------------|--------------------------------|--|-----------------------------------|-----------------------------|
| | | | | Actividad a desarrollar | Formato de entrega | Fecha y hora de solicitud | Fecha sugerida de entrega | Fecha y hora límite de entrega | Fecha de entrega de calificación y observaciones | Criterios de evaluación | Porcentaje de la evaluación |
| 13 | 27 abril - 3 mayo | | | Actividad 13: Reforzamiento U2 Temas 2.5, 2.6 y 2.7 | Cuestionario de opción múltiple en plataforma | 20 abril 00:00:00 | 10 mayo 23:55:00 | 20 de May 23:55 | 26 mayo | Elección de la respuesta correcta | 5% |
| 14 | 4 - 10 mayo | Trabajo final | | Trabajo final | Indicado en plataforma | 27 enero 00:00:00 | 20 mayo 10:00:00 | 20 de May 23:55 | 02 junio | Lista de cotejo | 20% |
| 15 | 11 - 17 mayo | | | | | | | 20 de May 23:55 | | | |
| 16 | 18 - 24 mayo | | Semana de ajuste Terminar actividades extra para subir calificación | | | | | | | | |