

Nombre de la asignatura	SERIES DE TIEMPO
Asesor	Nora Martínez Martínez
Presentación del asesor	Soy Maestra y Doctorante en Economía por la Facultad de Economía de la UNAM. Tengo un diplomado en Econometría y he participado en la impartición de varios diplomados, entre ellos uno de Planeación y otro en Estadística. Mi labor docente se ha enfocado principalmente al área de métodos cuantitativos.
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	<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 Híbrida



Metodología de trabajo

Sobre el curso.- El curso se desarrollará de forma híbrida: por un lado, la impartición de sesiones sabatinas durante el horario de clase usando zoom, y por el otro, el uso de la plataforma para los ejercicios a desarrollar. El alumno revisará previamente a la sesión los temas indicados de acuerdo a la dosificación correspondiente. La asistencia a las sesiones en zoom no se tomará en cuenta para la calificación, aunque es recomendable para la comprensión de los ejercicios a desarrollar. Cada alumno es responsable del ingreso a la plataforma para revisar las actividades a desarrollar, los plazos de entrega y las calificaciones obtenidas.

Sobre la comunicación.- La plataforma del curso sólo se utilizará para revisar material, tareas y calificaciones. Se prescindirá del uso del foro o mensajes en la plataforma; la comunicación entre nosotros se llevará a cabo durante las sesiones zoom y a través del correo electrónico exclusivamente.

Reglamento interno

1. La comunicación debe ser adecuada, buscando el respeto mutuo entre todos los integrantes del curso.
2. Regulen la interacción y el comportamiento académico de forma ética.
3. Las tareas copiadas serán calificadas con cero, para todos los que hayan copiado o dejado copiar.
4. Recuerden preguntar sus dudas siempre.
5. Compartan sus conocimientos.

Criterios de evaluación

- La evaluación se llevará a cabo mediante la entrega de 10 tareas a lo largo del curso; no habrá exámenes parciales como tampoco examen final.
- Para acreditar la asignatura deberán cumplir con un mínimo de 7 tareas entregadas.
- La escala de calificación será de 0 a 10, con la calificación mínima aprobatoria de 6.
- La calificación final obtenida será resultado del promedio de las 10 tareas asignadas durante el curso (suma de las calificaciones de las tareas entregadas / 10).
- Cualquier tarea entregada en donde se detecte copia tendrá calificación de cero.
- En caso de obtener una calificación reprobatoria se podrá realizar un examen de recuperación durante la última semana del curso, siempre y cuando hayan entregado por lo menos 7 de las tareas y equivaldrá al 100% de la calificación. Este examen estará disponible en la plataforma el día del examen y tendrá una duración de dos horas, dentro de las cuales deberán responder y subirlo a la plataforma en un archivo en formato PDF.
- El NP solamente aplica a aquellos alumnos que no asistieron o bien no fueron evaluados en ninguna tarea.
- La programación para la realización y entrega de las tareas estará disponible en la plataforma.
- Las tareas consisten en la realización de preguntas a resolver mediante procedimientos en Excel y Eviews, así como preguntas de interpretación, especificando el máximo de puntos a obtener. Las actividades deberán entregarse en formato PDF, nombrando el archivo como: el número de la tarea, apellido paterno y nombre del alumno, por ejemplo T3-Martínez-Nora.pdf.

Dosificación Modalidad Híbrida



Referencias

- Gujarati, D. (2009). *Econometría*. México: McGraw-Hill/Interamericana Editores.
- Pindyck R. (2001). *Econometría: Modelos y Pronósticos*. México: McGraw Hill.
- Anderson, D.R. (et.al.) (2004). *Estadística para Administración y Economía*. México: Thomson.
- Wooldridge, J. (2001). *Introducción a la Econometría: Un Enfoque Moderno*, México: Thomson.

Dosificación Modalidad Híbrida



Sesión	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	21 - 27 de sept.	UNIDAD I. ANÁLISIS DE SERIES DE TIEMPO I.1 Método de dominio de tiempo.	Gujarati, D. (2009). Cap. XXI.	Sin actividad.	Sin entrega.					
2	28 de sept. - 4 de oct.	Uso del Eviews. UNIDAD I. ANÁLISIS DE SERIES DE TIEMPO I.1 Método de dominio de tiempo. (Desestacionalización de una serie)		Tarea 1. Desestacionalización de una serie de tiempo.	En plataforma.	5 de oct. 2020, 23:55 hrs.	10 de oct. 2020, 8:55 hrs.	17 de oct. 2020	Considerar la información proporcionada. Utilizar Excel para desarrollar el ejercicio solicitado, y contestar acertadamente las preguntas.	10 %
3	5 - 11 de oct.	UNIDAD I. ANÁLISIS DE SERIES DE TIEMPO (Uso del Eviews). I.2 Series de tiempo estacionarias y no estacionarias.	Gujarati, D. (2009). Cap. XXI.	Tarea 2. Correlograma.	En plataforma.	12 de oct. 2020, 23:55 hrs.	17 de oct. 2020, 8:55 hrs.	24 de oct. 2020	Considerar la información proporcionada. Utilizar Eviews para desarrollar el ejercicio solicitado, y contestar acertadamente las preguntas.	10 %
4	12 - 18 de oct.	UNIDAD I. ANÁLISIS DE SERIES DE TIEMPO 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.	Gujarati, D. (2009). Cap. XXI.	Tarea 3. Pruebas de raíz unitaria.	En plataforma.	19 de oct. 2020, 23:55 hrs.	24 de oct. 2020, 8:55 hrs.	31 de oct. 2020	Considerar la información proporcionada. Utilizar Eviews para desarrollar el ejercicio solicitado, y contestar acertadamente las preguntas.	10 %
5	19 - 25 de oct.	UNIDAD I. ANÁLISIS DE SERIES DE TIEMPO I.4 Estimación de los	Gujarati, D. (2009). Cap. XXII.	Tarea 4. Modelos Ar, MA y ARMA.	En plataforma.	26 de oct. 2020,	31 de oct. 2020,	7 de nov. 2020	Considerar la información proporcionada.	10 %

Dosificación Modalidad Híbrida



Sesión	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
		modelos AR, MA y ARMA.				23:55 hrs.	8:55 hrs.		Utilizar Eviews para desarrollar el ejercicio solicitado, y contestar acertadamente las preguntas.	
6	26 de oct. - 1 de nov.	UNIDAD I. ANÁLISIS DE SERIES DE TIEMPO I.5 Significación de los coeficientes en los modelos de series de tiempo.	Gujarati, D. (2009). Cap. XXII.	Sin actividad.	Sin entrega.					
7	2 - 8 de nov.	UNIDAD II. AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y COINTEGRACIÓN II.1 El enfoque Box-Jenkins.	Gujarati, D. (2009). Cap. XXI.	Tarea 5. Regresión espúrea.	En plataforma.	9 de nov. 2020, 23:55 hrs.	14 de nov. 2020, 8:55 hrs.	21 de nov. 2020	Considerar la información proporcionada. Utilizar Eviews para desarrollar el ejercicio solicitado, y contestar acertadamente las preguntas.	10 %
8	9 - 15 de nov.	UNIDAD II. AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y COINTEGRACIÓN II.2 La regresión cointegradora.	Gujarati, D. (2009). Cap. XXI.	Tarea 6. Cointegración.	En plataforma.	16 de nov. 2020, 23:55 hrs.	21 de nov. 2020, 8:55 hrs.	28 de nov. 2020	Considerar la información proporcionada. Utilizar Eviews para desarrollar el ejercicio solicitado, y contestar acertadamente las preguntas.	10 %
9	16 - 22 de nov.	UNIDAD II. AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y COINTEGRACIÓN	Gujarati, D. (2009). Cap. XXI.	Tarea 7. Mecanismo de corrección del error.	En plataforma.	23 de nov. 2020, 23:55 hrs.	28 de nov. 2020, 8:55 hrs.	5 de dic. 2020	Considerar la información proporcionada. Utilizar Eviews para desarrollar el	10 %

Dosificación Modalidad Híbrida



Sesión	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
		II.3 Modelos de cointegración y de correlación de errores.							ejercicio solicitado, y contestar acertadamente las preguntas.	
10	23 - 29 de nov.	Repaso y aclaración de dudas.	Sin lectura.	Sin actividad.	Sin entrega.					
11	30 de nov. - 6 de dic.	UNIDAD II. AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y COINTEGRACIÓN II.4 Pruebas de cointegración.	Gujarati, D. (2009). Cap. XXI.	Tarea 8. Aplicación del procedimiento de cointegración (primera parte).	En plataforma.	7 de dic. 2020, 23:55 hrs.	12 de dic. 2020, 8:55 hrs.	9 de enero 2021	Considerar la información proporcionada. Utilizar Eviews para desarrollar el ejercicio solicitado, y contestar acertadamente las preguntas.	10 %
12	7 - 13 de dic.	UNIDAD II. AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y COINTEGRACIÓN II.5 Cointegración y pruebas REH y MEX.	Gujarati, D. (2009). Cap. XXI.	Sin actividad.	Sin entrega.					
13	4 - 10 de enero	UNIDAD II. AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y COINTEGRACIÓN II.5 Cointegración y pruebas REH y MEX (continúa).	Gujarati, D. (2009). Cap. XXI.	Tarea 9. Aplicación del procedimiento de cointegración (segunda parte).	En plataforma.	11 de enero 2021, 23:55 hrs.	16 de enero 2021, 8:55 hs.	23 de enero 2021	Considerar la información proporcionada. Utilizar Eviews para desarrollar el ejercicio solicitado, y contestar acertadamente las preguntas.	10 %
14	11 - 17 de enero	UNIDAD II. AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y	Gujarati, D. (2009). Cap. XXII.	Tarea 10. Modelo VAR..	En plataforma.	18 de enero 2021, 23:55	23 de enero 2021, 8:55 hrs.	30 de enero 2021	Considerar la información proporcionada. Utilizar Eviews para	10 %

Dosificación Modalidad Híbrida



Sesión	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	
		COINTEGRACIÓN II.6 Problemas con los modelos VAR.				hrs.				desarrollar el ejercicio solicitado, y contestar acertadamente las preguntas.	
15	18 -24 de enero	UNIDAD II. AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y COINTEGRACIÓN II.7 Volatilidad	Gujarati, D. (2009). Cap. XXII.	Sin actividad.	Sin entrega.						
16	25 - 31 de enero	Examen de recuperación (Para alumnos con calificación reprobatoria y entrega mínima de 7 de las tareas solicitadas).		Evaluación	Examen escrito y enviado en formato PDF.	30 de enero 2021, 12:00 hrs.	30 de enero 2021, 14:00 hrs.	6 de febrero 2021	Considerar la información proporcionada. Utilizar Eviews para desarrollar el ejercicio solicitado, y contestar acertadamente las preguntas. Sustituye la calificación del curso.	100%	