

Nombre de la asignatura	SERIES DE TIEMPO
Asesor	Oscar Guillermo Rodríguez Martínez
Presentación del asesor:	Es licenciado en economía egresado de la Facultad de Economía de la UNAM, obtuvo un MBA con especialidad en finanzas corporativas y bursátiles; cursó dos diplomados en la UNAM, el primero en ingeniería de la calidad, el segundo en economía de la salud.
	Desde el 2013 es profesor de la facultad de Economía en la UNAM, imparte las materias de contabilidad, series de tiempo, econometría y análisis de estados financieros, cuenta con experiencia laboral en el ámbito bursátil y financiero trabajando para aseguradoras. Actualmente cuenta con su propio despacho como intermediario de las mismas.
Semestre	Sexto
Requisito	Acreditar las materias de Calculo Diferencial Multivariado y Álgebra Lineal, Introducción a la Econometría, Estadística descriptiva e indicadores económicos.
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> <p>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.</p> <p>UNIDAD II. AUTOREGRESIÓN DE VECTORES, RAÍCES UNITARIAS Y COINTEGRACIÓN</p> <p>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.</p>

II.7 Volatilidad.

II.7.1 Procesos ARCH y GARCH

Metodología de trabajo

- Trabajo en clase
- Realización de lecturas y temas de investigación sugeridas por el profesor
- Contar con el 80% de asistencia
- Cuestionarios semanales de preguntas abiertas y opción múltiple para revisión en clase
- Entrega de tareas por correo electrónico
- Realización y revisión de ejercicios en clase
- Aplicación de un examen final

Reglamento interno

- Guardar seriedad y compostura, tanto en el interior del salón de clases, como fuera del edificio.
- Presentarse en los exámenes en las fechas que fije el profesor.

Criterios de evaluación

Para obtener el 50% de la calificación el alumno deberá realizarán quizzes semanales con preguntas directas y de opción múltiple, junto con las tareas y los ejercicios en clase. El otro 50% será un examen final de 20 preguntas de opción múltiple y abiertas.

Referencias

Alcalde, Á. (2002). *Econometría: Modelos deterministas y estocásticos*. México: Centro De Estudios Ramón Areces

Carrascal, U. (2005). *Análisis Econométrico con Eviews*. México, Alfaomega

Pindyck, R. (2001). *Econometría: Modelos y Pronósticos*. México, McGraw Hill

Sánchez, G. (2002). *Econometría*, México, Facultad de Economía, UNAM

Dosificación Modalidad Abierta 2019-I



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	11 agosto	Método dominio de tiempo Series estacionarias y no estacionarias	Búsqueda de información del tema relacionado	Tarea: Lectura del tema	Formato Word enviado por correo electrónico	11 agosto 11:50 am	17 agosto 11:50 pm		Contenido de acuerdo al tema, no cometer plagio, nombre	2.5%
2	18 agosto	Método dominio de tiempo Series estacionarias y no estacionarias	Búsqueda de información del tema relacionado	Quizzes en clase	Los quizzes son de forma física	18 agosto 11:00 am	18 agosto 11:10 am	La Retroalimentación sobre el tema se dara al término del Quiz	Responder el cuestionario completo	2.5%
3	25 agosto	Raíces unitarias Dickey-Fuller	Búsqueda de información del tema relacionado.	Tarea: Lectura del tema	Formato Word enviado por correo electrónico	25 agosto 11:50 am	31 agosto. 11:50 pm		Contenido de acuerdo al tema, no cometer plagio, nombre	2.5%
4	1 septiembre	Raices unitarias Phillips-Perron	Búsqueda de información del tema relacionado.	Tarea: Lectura del tema	Formato Word enviado por correo electrónico	1 sept 11:50 am	7 sept 11:50 pm		Contenido de acuerdo al tema, no cometer plagio, nombre	2.5%
5	8 septiembre	Cambio estructural	Búsqueda de información del tema relacionado.	Tarea: Lectura del tema	Formato Word enviado por correo electrónico	8 sept 11:50 am	21 sept 11:50 pm		Contenido de acuerdo al tema, no cometer plagio, nombre	2.5%
6	15 septiembre	ASUETO								
7	22 septiembre	Modelos AR, MA ARMA y significado de los coeficientes	Búsqueda de información del tema relacionado	Tarea: Lectura del tema Ejercicio solución de modelos AR , MA y ARMA	En clase	22 sept 11:20 am	22 sept 11:40 am	Los ejercicios se realizan de forma individual y se califican en clase	Responder el cuestionario completo Contenido de acuerdo al tema, no	2.5% 5.0%

Dosificación Modalidad Abierta 2019-I



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
									cometer plagio, nombre.	
8	29 septiembre	Metodología Box-Jenkins <ul style="list-style-type: none"> Identificación Estimación 	Búsqueda de información del tema relacionado	Tarea: Lectura del tema	Formato Word enviado por correo electrónico	29 sept 11:50 am	5 oct 11:50 pm	Los ejercicios se realizan de forma individual y se califican en clase	Contenido de acuerdo al tema, no cometer plagio, nombre.	2.5%
				Ejercicios en Eviews	En clase	29 sept 11:10 am	29 sept 11:40 am			Responder el cuestionario completo
9	6 octubre	Metodología Box-Jenkins <ul style="list-style-type: none"> Estimación Chequeo 	Búsqueda de información del tema relacionado	Ejercicios en Eviews	En clase	6 oct. 11:10 am	6 oct. 11:40 am	Los ejercicios se realizan de forma individual y se califican en clase	Responder el cuestionario completo	2.5%
10	13 octubre	Cointegración <ul style="list-style-type: none"> Modelos Errores 	Búsqueda de información del tema relacionado	Ejercicios y cuestionarios	En clase	13 oct. 11:30 am	13 oct. 11:50 am	Los ejercicios se realizan por equipo y se califican en clase	Responder el cuestionario completo	2.5%
11	20 octubre	Cointegración <ul style="list-style-type: none"> Prueba REH 	Búsqueda de información del tema relacionado	Ejercicios y cuestionarios	En clase	20 oct. 11:10 am	20 oct. 11:40 am	Los ejercicios se realizan por equipo y se califican en clase	Responder el cuestionario completo	2.5%
				Tarea: Lectura del tema	Formato Word enviado por correo electrónico	20 oct. 11:50 am	26 oct. 11:50 pm			Contenido de acuerdo al tema, no cometer plagio, nombre.
12	27 octubre	Cointegración <ul style="list-style-type: none"> Prueba MEX 	Búsqueda de información del tema relacionado	Ejercicios y cuestionarios	En clase	27 oct. 11:10 am	27 oct. 11:40 am	Los ejercicios se realizan por equipo y se califican en clase	Responder el cuestionario completo	2.5%
				Tarea: Lectura del tema	Formato Word enviado por correo electrónico	27 oct. 11:50 am	02 nov. 11:50 pm			Contenido de acuerdo al tema, no cometer

Dosificación Modalidad Abierta 2019-I



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
									plagio, nombre.	
13	3 noviembre	Modelos VAR <ul style="list-style-type: none"> Definición Problemas 	Búsqueda de información del tema relacionado	Tarea: Lectura del tema	Formato Word enviado por correo electrónico	3 nov. 11:50 am	9 nov. 11:50 pm	La Retroalimentación sobre el tema se dara al término del Quiz	Contenido de acuerdo al tema, no cometer plagio, nombre.	2.5%
				Quizzes en clase	Los quizzes son de forma física	3 nov. 11:30 am	3 nov. 11:50 am			
14	10 noviembre	Volatilidad. <ul style="list-style-type: none"> Proceso ARCH Proceso GARH 	Búsqueda de información del tema relacionado	Ejercicios y cuestionarios	En clase	10 nov. 11:10 am	10 nov. 11:50 am	Los ejercicios se realizan por equipo y se califican en clase	Responder el cuestionario completo	2.5%
15	17 noviembre	Repaso General		Ejercicios y cuestionarios	En clase	17 nov 11:10 am	17 nov. 11:50 am	Erjercicios en grupo para repaso general	Responder el cuestionario completo	2.5%
16	24 noviembre	Examen Final				24 nov. 11:10 am	24 nov. 11:50 am	Del 3 al 8 de diciembre se envía calificación por correo	Responder el cuestionario completo	50%