

23-24

MÁSTER UNIVERSITARIO EN
INVESTIGACIÓN EN ECONOMÍA

GUÍA DE ESTUDIO PÚBLICA



ANÁLISIS DE SERIES TEMPORALES

CÓDIGO 25503380

UNED

23-24

ANÁLISIS DE SERIES TEMPORALES
CÓDIGO 25503380

ÍNDICE

PRESENTACIÓN Y CONTEXTUALIZACIÓN
REQUISITOS Y/O RECOMENDACIONES PARA CURSAR ESTA ASIGNATURA
EQUIPO DOCENTE
HORARIO DE ATENCIÓN AL ESTUDIANTE
COMPETENCIAS QUE ADQUIERE EL ESTUDIANTE
RESULTADOS DE APRENDIZAJE
CONTENIDOS
METODOLOGÍA
SISTEMA DE EVALUACIÓN
BIBLIOGRAFÍA BÁSICA
BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA
RECURSOS DE APOYO Y WEBGRAFÍA

| | |
|---------------------------|---|
| Nombre de la asignatura | ANÁLISIS DE SERIES TEMPORALES |
| Código | 25503380 |
| Curso académico | 2023/2024 |
| Título en que se imparte | MÁSTER UNIVERSITARIO EN INVESTIGACIÓN EN ECONOMÍA |
| Tipo | CONTENIDOS |
| Nº ETCS | 5 |
| Horas | 125.0 |
| Periodo | SEMESTRE 2 |
| Idiomas en que se imparte | CASTELLANO |

PRESENTACIÓN Y CONTEXTUALIZACIÓN

Esta asignatura forma parte de la especialidad en Economía Cuantitativa del Máster. En particular se centra en el análisis de series temporales como instrumento para modelizar adecuadamente procesos económicos susceptibles de ser contemplados desde el análisis temporal.

Los datos económicos, tanto macroeconómicos como financieros, viene dados generalmente en observaciones temporales discretas. Las asignaturas relacionadas con la econometría han tratado parcialmente con este tipo de datos. Esta asignatura pretende especializarse fundamentalmente en la modelización de series temporales estocásticas y su estimación. Especial hincapié se hará en los problemas específicamente económicos propios de nuestras series.

Puede resultar especialmente útil para aquellos que profesionalmente quieran especializarse en el análisis y modelización de fenómenos y procesos temporales económicos y financieros.

REQUISITOS Y/O RECOMENDACIONES PARA CURSAR ESTA ASIGNATURA

Herramientas Informáticas para la Investigación en Economía
 Matemáticas (ecuaciones en diferencias finitas)
 Econometría (al nivel dado en el módulo básico)

EQUIPO DOCENTE

| | |
|--------------------|--|
| Nombre y Apellidos | MARIANO MATILLA GARCIA (Coordinador de asignatura) |
| Correo Electrónico | mmatilla@cee.uned.es |
| Teléfono | 91398-7215 |
| Facultad | FAC.CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES |
| Departamento | ECONOMÍA APLICADA Y ESTADÍSTICA |

| | |
|--------------------|---|
| Nombre y Apellidos | PEDRO ANTONIO PEREZ PASCUAL |
| Correo Electrónico | pperez@cee.uned.es |
| Teléfono | 91398-7801 |
| Facultad | FAC.CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES |
| Departamento | ECONOMÍA APLICADA Y ESTADÍSTICA |

Nombre y Apellidos
Correo Electrónico
Teléfono
Facultad
Departamento

BASILIO SANZ CARNERO
bsanz@cee.uned.es
91398-6330
FAC.CIENCIAS ECONÓMICAS Y EMPRESARIALES
ECONOMÍA APLICADA Y ESTADÍSTICA

HORARIO DE ATENCIÓN AL ESTUDIANTE

Contactar con el equipo docente:

Email: mmatilla@cee.uned.es

Teléfono: 91 398 7215

Dirección Postal:

Paseo Senda del Rey, 111. 28040 (Madrid)

Horarios: Miércoles 10.00 a 14.00

La atención se complementará con el Curso Virtual y sus Foros

COMPETENCIAS QUE ADQUIERE EL ESTUDIANTE

COMPETENCIAS BÁSICAS

CB6 - Poseer y comprender conocimientos que aporten una base u oportunidad de ser originales en el desarrollo y/o aplicación de ideas, a menudo en un contexto de investigación

CB7 - Que los estudiantes sepan aplicar los conocimientos adquiridos y su capacidad de resolución de problemas en entornos nuevos o poco conocidos dentro de contextos más amplios (o multidisciplinares) relacionados con su área de estudio

CB8 - Que los estudiantes sean capaces de integrar conocimientos y enfrentarse a la complejidad de formular juicios a partir de una información que, siendo incompleta o limitada, incluya reflexiones sobre las responsabilidades sociales y éticas vinculadas a la aplicación de sus conocimientos y juicios

CB9 - Que los estudiantes sepan comunicar sus conclusiones y los conocimientos y razones últimas que las sustentan a públicos especializados y no especializados de un modo claro y sin ambigüedades

CB10 - Que los estudiantes posean las habilidades de aprendizaje que les permitan continuar estudiando de un modo que habrá de ser en gran medida autodirigido o autónomo.

COMPETENCIAS GENERALES

CG01 - Aplicar los conocimientos adquiridos y su capacidad de resolución de problemas en entornos nuevos o poco conocidos dentro de contextos más amplios

CG02 - Integrar conocimientos y enfrentarse a la complejidad de formular juicios a partir de una información que, siendo incompleta y limitada, incluya reflexiones sobre las responsabilidades sociales y éticas vinculadas a la aplicación de sus conocimientos y juicios.

CG04 - Adquirir habilidades de aprendizaje que permitan continuar estudiando de un modo que habrá de ser en gran medida autodirigido y autónomo.

CG05 - Desarrollar el razonamiento crítico y la capacidad para realizar análisis y síntesis de la información disponible.

CG06 - Gestionar autónomamente y de forma autorregulada su trabajo.

COMPETENCIAS ESPECÍFICAS

CE01 - Saber identificar las necesidades y demandas de los contextos en los que se exige la aplicación de herramientas metodológicas y aprender a proponer soluciones adecuadas.

CE02 - Desarrollar el razonamiento y pensamiento crítico y la capacidad para realizar análisis de la realidad económica.

CE03 - Preparar los datos para el análisis y aplicar los conocimientos teóricos adquiridos a la práctica mediante la modelación económica, lo que implica conocer las diferentes herramientas de análisis así como su utilidad y aplicabilidad en cada contexto.

CE04 - Resolver problemas económicos en entornos nuevos o poco conocidos.

CE05 - Aprender a tomar decisiones y proponer soluciones apropiadas basándose en los modelos económicos estudiados.

CE06 - Manejar con soltura las Tecnologías de Innovación y Comunicación (TIC), aplicadas al área de Economía.

CE07 - Obtener información de forma efectiva lo que implica ser capaz de buscar, gestionar organizar y analizar la información bibliográfica relevante.

CE08 - Mantener un compromiso ético como investigador en la realización de trabajos.

CE09 - Adquirir habilidades para el inicio y desarrollo de la tesis doctoral.

CE10 - Desarrollar habilidades para evaluar la investigación proyectada por otros profesionales.

CE11 - Llegar a ser capaz de diseñar investigaciones propias en el ámbito del itinerario correspondiente.

CE12 - Conocer los principales modelos teóricos que subyacen en los diversos ámbitos específicos de la investigación.

RESULTADOS DE APRENDIZAJE

Modelización y Estimación de procesos univariantes.

Econometría de las Raíces Unitarias

Tendencias: Tipos, limitaciones y técnicas de análisis

Modelización GARCH

Modelos Multivariantes

CONTENIDOS

Tema 1. Modelos de Series Temporales Estacionarios

Tema 2. Modelización de la Volatilidad

Tema 3. Contrastar Tendencia y Raíces Unitarias

Tema 4. Modelos de series Multiecuacionales

Tema 5. Cointegración y Modelos ECM

METODOLOGÍA

El curso se desarrolla mediante el estudio y realización de una serie de ejercicios prácticos y teóricos.

En particular, cada tema tendrá un set de ejercicios que habrá que entregar en la plataforma aIF en tiempo y forma.

Todos ellos se adecuan a la metodología propia de la educación a distancia.

SISTEMA DE EVALUACIÓN

TIPO DE PRUEBA PRESENCIAL

Tipo de examen Examen de desarrollo

Preguntas desarrollo

Duración del examen 120 (minutos)

Material permitido en el examen

Calculadora no programable

Criterios de evaluación

Correcta resolución de los ejercicios diseñados

Claridad y rigor expositivo

% del examen sobre la nota final 60

Nota del examen para aprobar sin PEC

Nota máxima que aporta el examen a la calificación final sin PEC

Nota mínima en el examen para sumar la PEC

Comentarios y observaciones

CARACTERÍSTICAS DE LA PRUEBA PRESENCIAL Y/O LOS TRABAJOS

Requiere Presencialidad Si

Descripción

Examen con problemas similares a los trabajados en los bloques de ejercicios ha entregar a lo largo del curso

Criterios de evaluación

Ponderación de la prueba presencial y/o los trabajos en la nota final La prueba presencial pondera un 60 % sobre nota final

Fecha aproximada de entrega

Comentarios y observaciones

PRUEBAS DE EVALUACIÓN CONTINUA (PEC)

¿Hay PEC? No

Descripción

Criterios de evaluación

Ponderación de la PEC en la nota final

Fecha aproximada de entrega

Comentarios y observaciones

OTRAS ACTIVIDADES EVALUABLES

¿Hay otra/s actividad/es evaluable/s? Si, no presencial

Descripción

Bloques de ejercicios por temas.

La entrega se efectúa a través de la plataforma aLF.

Criterios de evaluación

Ponderación en la nota final

Hasta un 40%

Fecha aproximada de entrega

Comentarios y observaciones

Todos los ejercicios deberán presentarse en un archivo de texto editable apto para ser leído por WORD o preferiblemente LyX (obligatorio este formato para los alumnos que hayan cursado la asignatura de “Herramientas Informáticas....”)

¿CÓMO SE OBTIENE LA NOTA FINAL?

Si la nota del examen es 4 o superior, entonces $0,6(\text{nota_examen}) + 0,4(\text{nota_media_problemas})$

Si la nota del examen es inferior a 4, no se supera la asignatura, pero se guarda la nota en problemas para la convocatoria extraordinaria

BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

Editorial: Willey & Sons.

Título: Applied Econometrics Time Series

Autor: Walter Enders

ISBN: 978-0-471-23065-6

Segunda edición

(También son válidas las posteriores)

BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

Matilla, M., Pérez, P., y Sanz, B. *ECONOMETRÍA Y PREDICCIÓN*. McGrawHill (solo SEGUNDA EDICIÓN)

RECURSOS DE APOYO Y WEBGRAFÍA

El curso cuenta con un web propia en la que se van colgando lecturas, ejercicios por temas y otra información de interés.

También hay un curso virtual en aLF

IGUALDAD DE GÉNERO

En coherencia con el valor asumido de la igualdad de género, todas las denominaciones que en esta Guía hacen referencia a órganos de gobierno unipersonales, de representación, o miembros de la comunidad universitaria y se efectúan en género masculino, cuando no se hayan sustituido por términos genéricos, se entenderán hechas indistintamente en género femenino o masculino, según el sexo del titular que los desempeñe.