

ANÁLISIS DE SERIES TEMPORALES

Curso 2016/2017

(Código: 25503380)

1. PRESENTACIÓN

Esta asignatura se centra en el análisis de series temporales como instrumento para modelizar adecuadamente procesos económicos susceptibles de ser contemplados desde el análisis temporal.

2. CONTEXTUALIZACIÓN

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.

3. REQUISITOS PREVIOS RECOMENDABLES

Herramientas Informáticas para la Investigación en Economía

Matemáticas (ecuaciones en diferencias finitas)

Econometría (al nivel dado en el módulo básico)

4. 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

5. CONTENIDOS DE LA ASIGNATURA

Modelos de Series Temporales Estacionarios

Modelización de la Volatilidad

Contrastar Tendencia y Raíces Unitarias

Modelos de series Multiecuacionales

Cointegración y Modelos ECM

6.EQUIPO DOCENTE

- [MARIANO MATILLA GARCIA](#)
- [PEDRO ANTONIO PEREZ PASCUAL](#)
- [BASILIO SANZ CARNERO](#)

7.METODOLOGÍA

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

8.BIBLIOGRAFÍA BÁSICA

Comentarios y anexos:

Editorial: Willey & Sons.

Título: Applied Econometrics Time Series

Autor: Walter Enders

ISBN: 978-0-471-23065-6

Segunda Edición.

9.BIBLIOGRAFÍA COMPLEMENTARIA

10.RECURSOS DE APOYO AL ESTUDIO

11.TUTORIZACIÓN Y SEGUIMIENTO

Contactar con el equipo docente:

Email: mmatilla@cee.uned.es

Teléfono: 91 398 7215

Horarios: Miércoles 10.00 a 14.00

12.EVALUACIÓN DE LOS APRENDIZAJES

La asignatura se evaluará a través de la realización de ejercicios a lo largo del curso y con un examen presencial final. La

ponderación se indicará en la segunda parte de la Guía.

13.COLABORADORES DOCENTES

Véase equipo docente.