

FACULTAD DE ECONOMIA. TEMARIO PARA EL EXAMEN EXTRAORDINARIO DE TALLER VI DE METODOS CUANTITATIVOS .

PROFESOR GENARO SANCHEZ BARAJAS

X. SERIES DE TIEMPO

X.1. ¿Qué es, cómo se define una serie de tiempo univariante?

X.1.1. Evaluación

X.1.2. ¿Cómo se identifica la estacionalidad y la estacionariedad de las series de tiempo?

X.2. Estacionalidad: conceptos básicos para su identificación

X.2.1. Tipos de movimientos de las series temporales

X.2.1.1. Identificación

X.2.1.2. Nuevo escenario de análisis

X.2.1.3. Representación gráfica

X.2.3.1. Identificación del tipo de movimientos que muestra Y_t : tendencia secular: T_t

X.3. Ejercicios con Eviews suavizamiento de las series de tiempo

X.4. PROFUNDIZACION SOBRE LOS COMPONENTES Y ANÁLISIS DE SERIES DE TIEMPO

X.4.1. Identificación con datos mexicanos de Variaciones Cíclicas, C_t . arriba descritas

X.4.2. Identificación de Variaciones Estacionales, E_t .

X.4.2.1. ¿Cómo se eliminan las variaciones estacionales?

X.4.2.1.1. Método de la tendencia: también conocido como método de las relaciones de medias mensuales respecto a la tendencia.

X.4.2.1.2. Método de desestacionalización de las medias móviles

X.4.2.1.3. Método de variaciones estacionales a partir de índices estacionales.

X.4.2.1.4. Método de las diferencias estacionales.

X.5. Predicción de los valores de Y_t .

XI. ESTACIONARIEDAD Y RAICES UNITARIAS

XI.1. Estacionariedad

XI.1.1. Pruebas para identificar la estacionariedad en las series temporales.

XI.2. Prueba para identificar la raíz unitaria de Y_t .

XI.2.1. ¿Cómo saber si el coeficiente de correlación es o no cero?

XI.2.1.1. Pruebas para verificar si la serie temporal es o no estacionaria.

XI.3. Profundización conceptual

XI.3.1. Modelos con variables retardadas

XI.3.1.1. Modelos autorregresivos

XI.3.1.1.1. Conceptos básicos

XI.3.1.1.2. Procesos estocásticos integrados

XI.3.2. Propiedades de las series o variables integradas

XI.3.3. METODOLOGÍA DE BOX & JENKINS APLICADA EN LA PREDICCIÓN DE SERIES TEMPORALES

XI.3.3.1. Conceptos básicos necesarios para entender esta metodología

XI.3.3.1.1. Proceso estocástico

XI.3.3.1.2. Importancia de la estacionalidad en la identificación de tendencias

XI.3.3.1.2.1. Ruido blanco

XI.3.3.1.2.2. Modelo de caminata aleatoria: MCA

XI.3.3.1.2.3. Raíz unitaria

XI.3.3.1.2.4. Diferenciación

XI.3.3.1.2.5. Comentarios

XI.3.3.1.2.6. Conclusiones

XI.3.31.2.7. Regresión espuria

XI.3.3.1.2.8. Procedimiento para obtener el modelo ARIMA

XI.3.3.1.2.8.1. Características de los modelos ARIMA con los valores apropiados de p , d y q

XI.3.3.1.2.8.2. Descripción detallada de la metodología

XI.3.3.1.2.8.2.1. Referencias

XI.3.3.1.2.9. Metodología específica para la predicción

XI.3.3.1.2.9.1. Modelos ARIMA

XI.3.3.1.2.9.1. Evaluación de los modelos ARIMA

XI.3.3.1.2.9.1.2. Resumen de modelos ARIMA

XI.3.3.1.2.9.2. Modelos ARMA: Combinación de los procesos estocásticos autorregresivos AR y MA

XI.3.3.2. Relación secuenciada de actividades a desarrollar para aplicar la Metodología de Box & Jenkins (BJ)

XI.3.3.2.1. Pronóstico

XI.3.3.3. Algunas consideraciones sobre la metodología de Box & Jenkins

XI.4. Ejercicios con Eviews

XII. MODELOS DINAMICOS: DE VECTORES AUTORREGRESIVOS: VAR y VEC: VECTORES DE ERRORESCORREGIDOS, COINTEGRACION. PRONÓSTICO

XII.1. Los modelos VAR: VECTORES AUTORREGRESIVOS

XII.1.1. Sus bondades, alcance y limitaciones de los modelos VAR

XII.2. Los modelos VEC: MODELOS DE CORRECCIÓN DE ERROR

XII.3. Cointegración (Granger)

XII.3.1. Significado

XII.3.2. Pruebas que se hacen para verificar si Y_t y X_t están cointegradas

XII.3.3. Propiedades

XII.3.3.1. Características de dos o más series temporales

XII.3.3.2. El modelo de corrección del error, MCE o VEC en inglés

XII.3.3.3. Metodología sugerida para el uso de modelos VAR y VEC

XII.3.4.1. Modelo de Largo Plazo

XII.3.4.2. Modelo de Corto Plazo

XII.3.4.3. ¿Cuál es la relación entre los modelos de corto y largo plazo?

BIBLIOGRAFIA:

1.- Comprar en la librería de la FE el CD de mi autoría intitulado "INTRODUCCION A LA ECONOMETRIA"

2.- Imprimir el índice y verme con él para preparar a los alumnos interesados en este examen extraordinario.