Programa

Contenido:

Módulo I: Teoría asintótica, análisis univariado estacionario
Erick Lahura

Módulo II: Raíces Unitarias, Outliers y Cambio Estructural
Gabriel Rodríguez

Módulo III: Cointegración, Modelos de Volatilidad e Introducción a la Econometría Bayesiana
Gabriel Rodríguez

Módulo IV: Modelos no lineales. Volatilidad.
Gabriel Rodríguez

Evaluación:

Ejercicios Calificados: 4 (uno por módulo / 15% cada uno) 60%
Examen Parcial: 20%
Examen Final: (en semana 17) 20%

Horario:
Miércoles 7:00-10:00pm

Aula:
N 113
Módulo I: Análisis Univariado de Series de Tiempo Estacionarias

Contenido:

Sesión 1.1 y 1.2: Ecuaciones en Diferencia y Operadores de Rezagos

Sesión 1.3 y 1.4: Procesos Estacionarios ARMA

Sesión 1.5 y 1.6: Teoría Asintótica para observaciones independientes.

Sesión 1.7 y 1.8: Teoría Asintótica para observaciones dependientes.

Bibliografía Obligatoria


Bibliografía Complementaria


Módulo II: Raíces Unitarias, Outliers y Cambio Estructural

Contenido:

Sesión 2.1 y 2.2: Tests de Raíces Unitarias (Clásicos, Recientes, Cambio Estructural, Condición Inicial, Covariables, Outliers, Aplicaciones)

Sesión 2.3 y 2.4: Outliers (Efectos, Identificación y Modelización, Aplicaciones)

Sesión 2.5 y 2.6: Tests de Cambio Estructural

Sesión 2.7 y 2.8: Estimación de Modelos con Cambio Estructural

Bibliografía:

Libros


Papers:

**Tests de Raíz Unitaria**


Outliers (Effectos, Identificación and Modelización)


Tests de Cambio Estructural y Estimación de Modelos con Cambio Estructural


Módulo III: Cointegración, Modelos de Volatilidad, Filtros e Introducción a la Econometría Bayesiana

Contenido:

Sesión 3.1 y 3.2: Cointegración (Tests, Distribuciones, Aplicaciones)

Sesión 3.3 y 3.4: Tendencias Estocásticas (Teoría y Aplicaciones)

Sesión 3.5 y 3.6: Modelos de Volatilidad (ARCH, GARCH, EGARCH, Otros y Aplicaciones)

Sesión 3.7 y 3.8: Filtros o Introducción a Econometría Bayesiana

Bibliografía:

Cointegración (Tests, Distribuciones, Aplicaciones)


**Tendencias Estocásticas (Teoría y Aplicaciones)**


Modelos de Volatilidad (ARCH, GARCH, EGARCH, Otros y Aplicaciones)


Filtros, Descomposición Tendencia-Ciclo


Módulo IV: Modelos no lineales. Volatilidad

Contenido:

Sesión 4.1 y 4.2: Descomposición Tendencia-Ciclo

Sesión 4.3 y 4.4: Filtro de Desestacionalización

Sesión 4.5 y 4.6: Modelos de Transición Suave (STAR)

Sesión 4.7 y 4.8: Modelos de Cambio de Régimen de Markov (MS)

Bibliografía:


