



Análisis de Serie de tiempo

Temario

I. Introducción: Conceptos relevantes

- Análisis y componentes de las series de tiempo
- Procesos estocásticos. Estacionariedad.
- Función de autocovarianza y función de autocorrelación
- Función de autocorrelación parcial

II. Métodos de suavizamiento exponencial

- Suavizamiento exponencial simple
- Suavizamiento exponencial doble
- Método de Holt
- Método de Holt-Winter
- Pronóstico puntual y por intervalos
- Aplicaciones

III. Modelos Arima

- Modelo autorregresivo
- Modelo de promedios móviles
- Modelo autorregresivo y de promedios móviles
- Modelo autorregresivo integrado y de promedios móviles
- Construcción de modelos: identificación, estimación y verificación
- Pronóstico puntual y por intervalos
- Aplicaciones

IV. Vectores Autoregresivos (VAR)

- Estructura y estimación
- Pronósticos
- Funciones impulso respuesta
- Descomposición de la varianza
- Cointegración
- Modelo de corrección de errores
- Aplicaciones



Referencias

Bibliografía básica

1. Bowerman, B, O'Connell, R.T., Koehler, A. (2010), "Forecasting, Time Series and Regression, *Cengage Learning*.
2. Guerrero, Víctor M. (2009). "Análisis Estadístico y Pronósticos de Series de Tiempo Económicas", *Jit Press*, 3ª. ed. México
3. Johnston, J. y J. Dinardo (1997), "Econometric Methods", *McGraw Hill*, 4ª ed.

Bibliografía de consulta

1. Pindyck, R. & Rubinfeld, D. (1998) "Econometría: Modelos y Pronósticos", *Mc. Garw Hill*, cuarta edición.
2. Gujarati Damodar N, (2004), "Econometría", *Mc. Garw Hill*, quinta edición.
3. Enders, W. (2010), "Applied Econometric Time Series". *Wiley*, 3ra ed, NY.