



**FACULTAD DE CIENCIAS
ECONÓMICAS Y
EMPRESARIALES
BADAJOZ
CURSO 07-08**



ASIGNATURA:

SERIES TEMPORALES

Titulación:

Licenciatura en Economía

Curso:	Temporalidad:	Créditos:		
		Totales	Teóricos	Prácticos
Cuarto	Cuatrimstral (2º)	4,5	3	1,5

Profesorado:

Apellidos, Nombre:

Página Web

Ramajo Hernández, Julián	http:// eco.unex.es/~jramajo/
Nogales Guillén, Luciano	--

Departamento:

Página Web

Economía Aplicada y Organización de Empresas	http:// eco.unex.es/decapoe/
---	--

Área:

Página Web

Métodos cuantitativos para la economía y la empresa	--
--	----



**FACULTAD DE CIENCIAS
ECONÓMICAS Y
EMPRESARIALES
BADAJOZ
CURSO 07-08**



Objetivos:

Este curso proporciona una descripción detallada de la amplia variedad de modelos que actualmente se utilizan en el análisis empírico de series temporales. Los objetivos que se pretenden conseguir son:

a) Objetivo principal: el alumno debe ser capaz de seleccionar la técnica apropiada de entre los métodos estudiados en cada uno de los temas, siendo capaz de especificar el modelo correspondiente, de contrastar las hipótesis estadísticas más relevantes y de interpretar los resultados obtenidos desde el punto de vista econométrico y de la teoría económica.

b) Objetivos secundarios:

-Ser capaz de diferenciar cuando es necesario la utilización de cada uno de los modelos estudiados en el curso.

-Ser capaz de comprender, interpretar y evaluar críticamente los análisis empíricos en los que intervengan dichos modelos.

-Ser capaz de estimar eficientemente los modelos estudiados mediante al menos un paquete econométrico (en particular, el EViews).

Temario:

TEMA I: INTRODUCCIÓN: PROPIEDADES Y COMPONENTES BÁSICAS DE LAS SERIES TEMPORALES EN ECONOMÍA, EMPRESA Y FINANZAS.

TEMA II: MODELOS LINEALES ESTOCÁSTICOS BÁSICOS

TEMA III: ANÁLISIS DE LA TENDENCIA

TEMA IV: ESTACIONALIDAD

TEMA V: OBSERVACIONES ATÍPICAS

TEMA VI: HETEROSCEDASTICIDAD CONDICIONAL

TEMA VII: MODELOS ESTOCÁSTICOS NO LINEALES



**FACULTAD DE CIENCIAS
ECONÓMICAS Y
EMPRESARIALES
BADAJOZ
CURSO 07-08**



Bibliografía:

BÁSICA:

- **A. AZNAR y F.J. TRÍVEZ:** "Métodos de predicción en economía (II): Análisis de series temporales", Ariel Economía, 1993.
- **H. LÜTKEPOHL y M. KRÄTZIG:** "Applied Time Series Econometrics", Cambridge University Press, 2004.
- **P.H. FRANSES:** "Time series models for business and economic forecasting", Editorial Cambridge University Press, 1998.
- **T.C. MILLS:** "The Econometric Modelling of Financial Time Series", Segunda Edición, Cambridge University Press, 1999.

COMPLEMENTARIA:

- **J.D. HAMILTON:** "Time Series Analysis", Princeton University Press, 1994.
- **H. LÜTKEPOHL:** "Introduction to Multiple Time Series Analysis", Second Edition, Springer-Verlag, 1993.

Enlaces:

El soporte fundamental del curso, junto con los libros de referencia antes citados, es la página <http://eco.unex.es/jramajo/st.htm> , que contiene los datos y material complementario de los manuales básicos.

Criterios de evaluación:

- Para superar la asignatura, es requisito necesario que el alumno supere un examen final que recogerá cuestiones tanto teóricas como prácticas relativas a diferentes temas del programa.
- En el examen el alumno no debe mostrar un claro desconocimiento de algunos de los temas planteados. En otras palabras, si un alumno obtiene en algún ejercicio una puntuación que refleja



**FACULTAD DE CIENCIAS
ECONÓMICAS Y
EMPRESARIALES
BADAJOZ
CURSO 07-08**



un claro desconocimiento de dicho tema, el alumno no superará la asignatura.

- La asistencia con participación activa a las clases y prácticas se valorará positivamente.

Normas para la realización del examen:

- En el examen, escriba sus datos de identificación de forma clara y con letras mayúsculas.
- Coloque su D.N.I., o documento que acredite su identidad, en la parte superior del pupitre para que en cualquier momento del examen pueda comprobarse su identidad. Aquella persona que no pueda identificarse deberá abandonar el examen.
- El examen constará de diferentes ejercicios con sus correspondientes apartados. Cada apartado del examen tiene asignada una puntuación que se indicará en el examen. Las cuestiones planteadas en cada ejercicio pueden ser tanto de tipo teórico como práctico.
- Para que las respuestas se consideren correctas deberán realizarse y presentarse en las hojas de respuesta de manera explícita los cálculos u operaciones necesarias a la hora de argumentar y/o sostener las respuestas.
- Deberá figurar de modo explícito cada una de las hipótesis que se contraste, así como el contraste utilizado.
- Salvo que se indique de otro modo, se utilizará un nivel de significación estadística del 5 por ciento.
- Se valorará la claridad de los razonamientos y operaciones.
- Normalmente, el tiempo para la realización del examen está comprendido entre 2 horas (como mínimo) y 4 horas (máximo). La duración más habitual son 3 horas y media.
- Al finalizar el examen deberá entregar el examen junto con la hoja de respuesta.
- El alumno deberá traer al examen las tablas estadísticas recomendadas en las clases: distribución normal estandarizada, distribución t , distribución F , distribución χ^2 , estadístico d de Durbin-Watson, etc.
- En el examen será necesario que cada alumno lleve una calculadora que le permita realizar los cálculos de los ejercicios. En cualquier momento del examen el profesor podrá examinar la calculadora. La incorporación de información relativa a la asignatura en la memoria de la calculadora hará que el alumno abandone el examen.

Tutorías:

Despacho:	1^{er} Cuatrimestre:	2^o Cuatrimestre:
Despacho nº 50 del Edificio de Departamentos	Lunes (12h a 14h30), Martes (11h a 14h30, 18 h a 19 h)	Lunes (12h a 14h30), Martes (11h a 14h30)

Observaciones:

Como complemento a las tutorías personalizadas, puede utilizarse el correo electrónico del profesor (ramajo@unex.es) para plantear cuestiones sobre la asignatura.