



SEMINARIO DE INVESTIGACIÓN DEL PROGRAMA DE DOCTORADO EN ECONOMÍA Y EMPRESA
Curso 2014-2015

Título: Modelos de series temporales: una visión práctica

Ponente: Profesor Juan del Hoyo Bernat (Departamento de Financiación e Investigación Comercial)

Fecha: 22 y 23 de abril de 2015 de 13:30 a 15:00

Lugar de celebración: Instituto de Predicción Económica "Lawrence Klein"

Organizan: Departamento de Financiación e Investigación Comercial/Instituto de Predicción Económica "Lawrence Klein".

OBJETIVOS Y CONTENIDO

Este Seminario de Investigación consiste en una aproximación teórica con orientación práctica en el análisis de series temporales, en especial en el contexto de los modelos ARMA, ARIMA y de Regresión Dinámicos, y está dirigido a profesores, alumnos de posgrado y, concretamente, de doctorado no familiarizados con las técnicas de modelización de series temporales económicas. Consiste en dos sesiones de 90 minutos cada una y será impartido por el Dr. Juan del Hoyo Bernat, Profesor Emérito del Departamento de Financiación e Investigación comercial, de acuerdo con el siguiente contenido.

PRIMERA SESIÓN (22 de abril de 2015 de 13:30 a 15:00)

Primera parte (Introducción): 1. ¿Modelos lineales o no lineales? 2. Justificación del modelo lineal: el modelo de "pequeñas perturbaciones". 3. El papel de la Teoría en la especificación de modelos. 4. La condición Ceteris Paribus y la condición de estacionariedad. 5. El modelo uniecuacional general y casos particulares. 6. El modelo multiecuacional.

Segunda parte (Teórica): 1. Instrumentos básicos: FAC y FAP. 2. Identificación de modelos puros: AR(p) y MA(q). 3. Identificación de modelos ARMA(p,q). 4. Identificación de modelos de regresión con perturbaciones autocorreladas. 5. Criterios de Información. 6. Estimación y Contraste del modelo. 7. Predicción.

SEGUNDA SESIÓN (23 de abril de 2015 de 13:30 a 15:00)

Tercera Parte (Práctica): 1. Análisis de los datos. 2. Transformación de estacionariedad. 3. Casos prácticos. 4. Análisis de resultados.

Con el fin de organizar la logística del Seminario, se ruega a los interesados confirmen previamente la asistencia a juan.hoyo@uam.es con copia a ramon.lanza@uam.es

Se expedirá certificado de asistencia.