



## CURSO REGIONAL SOBRE HOJA DE BALANCE DE ALIMENTOS, SERIES DE TIEMPO Y ANÁLISIS DE POLÍTICA

### Análisis de Series de Tiempo

Sede Subregional de la CEPAL en México

Ciudad de México, del 19 al 23 de enero, 2015

#### OBJETIVOS

- ♦ Introducir a los participantes en el manejo de series de tiempo: aprender a conocer su serie.
- ♦ Capacitar a los participantes en el uso de modelos de series de tiempo que permiten realizar pronósticos.
- ♦ Capacitar a los participantes en el manejo básico de E-views y de aquellas opciones que permiten procesar series de tiempo.
- ♦ Introducir a los participantes en el uso del TSW+.

#### CONTENIDO:

**Tema I:** Conociendo una serie de tiempo y conceptos básicos

**Tema II:** Modelos ARIMA univariantes. Proceso de construcción, diagnóstico y pronóstico. Problemas en los residuos y soluciones. Análisis de Intervención.

**Tema III:** Comparación entre modelos

**Tema IV:** Extracción de señales: tendencia-ciclo, estacionalidad, irregular

**Tema V:** TSW+

**Tema VI:** Aportes de las series de tiempo al análisis de coyuntura

#### METODOLOGÍA

Los temas serán desarrollados en la clase mediante el uso de presentaciones en power-point. Cada tema será ilustrado con ejemplos que serán desarrollados simultáneamente por la instructora y los participantes. Se podrá llevar a cabo una práctica individual con alguna serie del interés de cada participante interés.

#### BIBLIOGRAFÍA

- ♦ Espasa, A. y Cancelo, J.R. (1993). **Métodos cuantitativos para el análisis de la coyuntura económica**. Madrid: Alianza Editorial.
- ♦ Eurostat. January 2000. **Eurostat recommendation concerning Seasonal Adjustment Policy**. Eurostat task force on seasonal adjustment policy (1996 to 1998).

- ♦ Hernández, Sandra. **El X-13ARIMA-SEATS como método de desestacionalización**. Septiembre 2013.
- ♦ Hernández, Sandra y Espinoza, Eduardo. **El uso de señales en el análisis de coyuntura**. Octubre 2011.
- ♦ Johnson Medina, Christian. **Econometría Intermedia**. Universidad Adolfo Ibañez, Chile. Agosto 2008. Capítulo 11.
- ♦ Makridakis, Wheelwright, McGee. 1998. **Forecasting: Methods and applications**. Segunda edición. John Wiley & Sons. Pág. 20 a 41.
- ♦ Maravall, Agustín. 1999. **Short-Term Analysis of Macroeconomic Time Series**. Economics: Beyond the millennium. Oxford: Oxford University Press. Editado por Alan Firman y Gérard-Varet. Pag 244-272.
- ♦ Pankratz, Alan. 1991. **Forecasting with Dynamic Regression Models**. John Wiley and Sons. USA. Pag. 34 a 39 y 297 a 309.

#### PROGRAMAS INFOMÁTICOS GRATUITOS

- ♦ El Banco de España permite descargar en forma gratuita el paquete Tramo-Seats (**TSW+**) en:  
[http://www.bde.es/bde/es/secciones/servicios/Profesionales/Programas\\_estadi/Programas\\_estad\\_d9fa7f3710fd821.html](http://www.bde.es/bde/es/secciones/servicios/Profesionales/Programas_estadi/Programas_estad_d9fa7f3710fd821.html)
- ♦ El US Census Bureau permite descargar en forma gratuita el **paquete X-13ARIMA-SEATS** en:  
<http://www.census.gov/srd/www/winx13/index.html#x13data>