

UNIVERSIDAD DE SONORA
UNIDAD REGIONAL CENTRO
DIVISIÓN DE CIENCIAS ECONÓMICAS Y ADMINISTRATIVAS
DEPARTAMENTO DE ECONOMÍA
LICENCIATURA EN FINANZAS

DATOS GENERALES

Nombre de la Materia: Índices, Series de Tiempo y Pronostico			
Eje de Formativo:	Eje de formación Profesional	Clave:	005
Área Académica:	Finanzas	Créditos:	8
Semestre:	Sexto	Hrs. / semana:	5
Requisito (s):	0247	Hrs. / teoría:	3
Carácter:	Obligatoria	Hrs. / laboratorio:	2
Modalidad:	Asignatura	Hrs. / Semestre:	85
Ciclo escolar.	2003-2		
Departamento de Servicio:	Departamento de Matemáticas		

INTRODUCCION

El curso de Índices, Series de Tiempo y Pronóstico plantea las herramientas metodológicas del calculo y la construcción de números índice simples y complejos para construir series de información que permitan correlacionar su comportamiento pasado y presente con el pronostico.

OBJETIVO GENERAL

Dotar al alumno de un conjunto de procedimientos y técnicas modernas de la estadística, útiles en el análisis, modelación y pronostico de datos estadísticos conformados en series de tiempo y que son resultado del comportamiento de los agentes económicos que interactúan en los mercados de bienes y servicios, de capitales y, específicamente, en los mercados financieros. Los fenómenos cíclicos, de tendencia, estacionalidad e irregularidad son propios de las series de tiempo en variables como los monetarios y financieros; inversión privada, consumo agregado, producto interno bruto y tipo de cambio en la economía de un país.

OBJETIVOS PARTICULARES:

- Al concluir el curso, el estudiante será capaz de analizar una serie de tiempo cualquiera, modelar su comportamiento actual y predecir su comportamiento futuro más probable
- Aprenderá los principales métodos para extrapolación, suavización y ajuste estacional de una serie de tiempo
- Obtendrá las propiedades estadísticas más importantes de una serie de tiempo
- Clasificará los principales modelos teóricos de las series de tiempo a partir de sus propiedades
- Definirá con precisión estocásticos estacionarios, invertibles y homogéneos
- Conocerá y aplicará los principales métodos de estimación y verificación de los modelos de series de tiempo
- Realizará pronósticos sobre el comportamiento probable de una serie de tiempo y dispondrá de criterios para su correcta evaluación
- Analizará la influencia de fenómenos exógenos u otras causas sobre el comportamiento de una serie de tiempo

VINCULOS DE LA ASIGNATURA CON LOS OBJETIVOS CURRICULARES

Corresponde al sexto semestre de Plan de estudios de la Licenciatura en Finanzas y constituye parte del grupo de materias como estadística y econometría que aportan la capacidad de procesamiento, representación numérica y e interpretación de los fenómenos económicos y financieros en la economía nacional, los sectores económicos y en las empresas.

CONTENIDO SINTETICOS

- 1.- Construcción de índices
- 2.- aplicación de índices
- 3.- Introducción a las series de tiempo
- 4.- Propiedades de las series de tiempo estatocasticas
- 5.- Modelos lineales de series de tiempo
- 6.-Estimación y verificación
- 7.- Pronostico con series de tiempo
- 8.- Análisis de intervención

ESTRATEGIAS DIDACTICAS

- Exposición del maestro
- Discusión grupal sobre los contenidos del curso
- Resúmenes analíticos de lecturas
- Planteamiento y resolución de problemas
- Elaboración de trabajo donde se apliquen conocimientos a la resolución de un problema practico.

SISTEMA DE EVALUACION

- 1.- Participación en discusión grupal sobre problemas planteados en clase y en tareas. 20%
- 2.- Aplicación de 3 exámenes parciales que cubrirán el 40%
- 3.- Tareas de problemas aplicados a resolver 20%
- 4.- Presentación de un trabajo 20%

BIBLIOGRAFÍA; DOCUMENTACION Y MATERIALES DE APOYO

- Pindick, Robert S, Y Rubinfeld, Daniel. "Econometric models and economic forecasts," Mc Graw Hill internacional edti 4ta edicion USA 1998
- Diebold Francis X. "elementos de pronostico" México: international Thomson editores 1999
- Quintana Romero Luis "econometría, modelos econométricos y pronósticos" Itesm-cem editorial MIMEO 1999
- Guerrero Victor "análisis estadístico de series de tiempo económicos" editado por UNAM, México 1991
- Guerrero, Víctor, Análisis estadístico de series de tiempo económicos editados por la UNAM Iztapalapa, Méx., 1991
- Aznar A. Y Trivez F. "métodos de predicción en economía II: análisis de series temporales" Edith Ariel, Economía España 1993

PERFIL DOCENTE

<p>Formación Académica: El profesor deberá tener estudios de Licenciatura en Economía, Finanzas o carrera a fin con postgrado mínimo de maestría con conocimientos de matemáticas aplicadas al campo de las finanzas, la economía y la administración.</p> <p>Experiencia docente; Haberse desempeñado como docente en la enseñanza a nivel de educación superior en el área de Matemáticas aplicadas a las Finanzas, Administración y Contabilidad. Contar con buenos antecedentes laborales en al área docente</p> <p>Formación didáctica y Pedagógica; Facilidad en el desempeño de la tareas docentes de enseñanza – aprendizaje Facilidad de comunicación grupal e individual con los alumnos Capacidad para utilizar tecnologías didácticas; computadora, proyectos de imágenes, cañones, acetatos, diapositivas, videos, etc.</p>

RESPONSABLE DEL PROGRAMA ACADÉMICO

Nombre (Elaboró);
Cargo;
Fecha de aprobación;
Firma:
Lugar.