Cursos de postgrado

30 créditos

Curso académico 2014-2015

Predicción económico-empresarial

del 28 de noviembre de 2014 al 30 de septiembre de 2015

DIPLOMA DE EXPERTO UNIVERSITARIO

Características: material impreso, página web y guía didáctica.

Departamento

Economía Aplicada Cuantitativa I

Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales

PROGRAMA DE POSTGRADO

Máster, Diploma de Especialización, Diploma de Experto y

Certificado de Formación del Profesorado.

Curso 2014/2015

El Programa de Postgrado acoge los cursos que dan derecho a la obtención de un Título Propio otorgado por la UNED. Cada curso se impartirá en uno de los siguientes niveles: Máster, Diploma de Especialización, Diploma de Experto y Certificado de Formación del Profesorado.

Máster: mínimo de 60 ECTS.

Diploma de Especialización: mínimo de 30 ECTS.

Diploma de Experto: mínimo de 15 ECTS.

Certificado de Formación del Profesorado: 6 ECTS.

Requisitos de acceso:

Estar en posesión de un título de grado, licenciado, diplomado, ingeniero técnico o arquitecto técnico. El director del curso podrá proponer que se establezcan requisitos adicionales de formación previa específica en algunas disciplinas.

Asimismo, de forma excepcional y previo informe favorable del director del curso, el Rectorado podrá eximir del requisito previo de la titulación en los cursos conducentes al Diploma de Experto Universitario. Los estudiantes deberán presentar un curriculum vitae de experiencias profesionales que avalen su capacidad para poder seguir el curso con aprovechamiento y disponer de acceso a la universidad según la normativa vigente.

El estudiante que desee matricularse en algún curso del Programa de Postgrado sin reunir los requisitos de acceso podrá hacerlo aunque, en el supuesto de superarlo, no tendrá derecho al Título propio, sino a un Certificado de aprovechamiento.

Destinatarios

El curso se dirige a titulados universitarios que necesiten utilizar predicciones en el área de la Economía y los Negocios

Tiene como objetivo que sus titulados dispongan de las herramientas necesarias para tomar decisiones en estos ámbitos.

1. Presentación y objetivos

La elaboración de pronósticos en economía es una actividad inevitable, dado que son imprescindibles en el proceso de decisión. En general podemos afirmar que la mayoría de la toma de decisiones suelen conllevar problemas de predicción.

Estas predicciones vendrán afectados por un elevado grado de incertidumbre.

Este curso proporciona herramientas para poder llevar a cabo pronósticos cualquiera que sea el ámbito en el que se necesiten utilizando la información de la forma más eficiente.

2. Contenidos

I FUNDAMENTOS DEL ANÁLISIS DE REGRESIÓN

1. Econometría: modelos y datos

1. Los modelos econométricos. 2. Efectos causales o estructurales. 3. Estructura de los datos económicos 4. Conclusión

2. Análisis de regresión lineal. estimación

1. Modelo de regresión 2. Mínimos cuadrados ordinarios 3. Regresión múltiple

3. Análisis de regresión lineal. Inferencia

1. Supuestos clásicos para datos transversales y temporales. 2. Distribución muestral de los estimadores MCO. 3. Inferencia. 4. Predicción

4. Regresión con heterocedasticidad y autocorrelación

1. Modelos de regresión con heterocedasticidad 2. Modelos de regresión con autocorrelación 3. Inferencia con heteroscedasticidad y autocorrelación

5. Variables explicativas dicotómicas

1. Modelos ANOVA 2. Modelos ANCOVA 3. Interacciones con variables dicotómicas 4. Estacionalidad 5. Regresión por tramos

6. Análisis de especificación y problemas con los datos

1. Selección de variables 2. Mala especificación funcional 3. Errores de medida 4. Otras fuentes de invalidez del modelo

II AMPLIACIÓN DEL ANÁLISIS DE REGRESIÓN

7. Regresión con variables instrumentales

1. Estimador de VI en un modelo de regresión simple 2. Modelo general de regresión VI

3. La regresión VI para la resolución de problemas de endogeneidad 4. Validez de los instrumentos . 5. Expresión matricial y

estimación de la regresión VI

8. Regresión con datos de panel y fusionados

1. Datos fusionados 2. Datos de panel

9. Regresión con variable dependiente binaria

1. Introducción 2. El modelo lineal de probabilidad 3. El modelo logit 4. El modelo probit

III SERIES TEMPORALES: PREDICCIÓN Y REGRESIÓN

10. Alisados

1. Suavizado exponencial simple 2. Tendencia lineal de Holt 3. Método de tendencia exponencial 4. Método de tendencias amortiguadas 5. Método estacional de Holt-Winters

11. Modelos estacionarios de series temporales

1. Procesos estocásticos 2. Procesos integrados 3. Procesos AR 4. Procesos MA 5. Procesos ARMA 6. Procesos ARIMA 7. Procesos SARIMA 8. Identificación, validación y predicción

12. Modelos dinámicos

1. Introducción 2. Modelos con retardos distribuidos y Modelos con retardos 3. Supuestos de los modelos dinámicos 4. Estimación de los modelos dinámicos 5. El modelo dinámico completo

13. Análisis espectral

1. El espectro y sus propiedades. 2. Relación entre el espectro y la FAC. 3. El periodograma como estimador del espectro: propiedades 4. Estimador consistente del espectro

14. Tendencias, raíces unitarias y regresiones espurias

1. Concepto de tendencia 2. Regresiones espurias 3. Contraste de raíces unitarias

15. Modelos tipo ARCH

1. Procesos autorregresivos con varianza condicionada heterocedástica 2. Propiedades adicionales de los procesos GARCH 3. Otros modelos tipo ARCH: TAR y EGARCH

16. Introducción a los modelos VAR

1. Introducción 2. Estimación y orden del VAR 3. Diferentes formas del VAR 4. Predicción 5. Causalidad de Granger, respuesta al impulso y descomposición de la varianza

17. Cointegración

1. Descripción del concepto de cointegración 2. Contraste de cointegración. 3. El teorema de representación de Granger 4. Efectos dinámicos en el modelo de retardos distribuidos 5. Cointegración con más de dos variables 6. Contraste de cointegración de Johansen

3. Metodología y actividades

Se empleará la metodología propia de la UNED, basada en la enseñanza a distancia, lo que permite al alumno seguir el curso sin

desplazamientos, cualquiera que sea su lugar de residencia, y compatibilizando sus responsabilidades laborales y familiares.

Con el curso obtendrá una adecuada formación a partir de las siguientes ayudas:

- Material didáctico que desarrolla el programa del curso.
- Tutorías, pueden ser telefónicas, por carta o correo electrónico.
- Pruebas de evaluación a distancia.

Se editará una guía didáctica para orientar al alumno sobre la mejor forma de aprovechar el programa en sus distintos niveles y se le asesorará a lo largo del curso a través de tutorías, ayudándole en todo momento en la resolución de cualquier duda que pueda plantearle la preparación del programa.

El contacto con los alumnos será mediante teléfono, carta o correo electrónico.

4. Material didáctico para el seguimiento del curso

4.1 Material obligatorio

4.1.1 Material enviado por el equipo docente (apuntes, pruebas de evaluación, memorias externas, DVDs,)

Material impreso elaborado por el Equipo Docente del curso

Este material será abonado por el alumno junto a la matrícula del curso.

5. Atención al estudiante

Horario de atención al alumnos,

Miércoles lectivos de 16 a 20 horas

Teléfono: 91 3987801

Fax: 91 3986336

Correo electrónico: pperez@cee.uned.es

Dirección postal:

Pedro A Pérez Pascual

UNED. Facultad de Ciencias Económicas y Empresariales

Departamento de Economía Aplicada Cuantitativa I

Paseo Senda del Rey, 11

Despacho 1.22

28040 Madrid

6. Criterios de evaluación y calificación

Superación de diversas pruebas a distancia de naturaleza teórico práctica relacionadas con la materia propia del curso y que el alumno deberá entregar en los plazos establecidos.

7. Duración y dedicación

Para un adecuado seguimiento del curso se aconseja una dedicación de 6-8 semanales, en el periodo de 28-11-2014 al 28-09-2015

8. Equipo docente

Director/a

Director - UNED

PEREZ PASCUAL, PEDRO ANTONIO

Colaboradores UNED

Colaborador - UNED

MATILLA GARCIA, MARIANO

Colaborador - UNED

SANZ CARNERO, BASILIO

9. Precio del curso

Precio de matrícula: 930,00 €.

Precio del material: 270,00 €.

10. Descuentos

10.1 Ayudas al estudio y descuentos

Se puede encontrar información general sobre ayudas al estudio y descuentos en [este enlace](#).

Debe hacer la solicitud de matrícula marcando la opción correspondiente, y posteriormente enviar la documentación al correo: descuentos@fundacion.uned.es.

11. Matriculación

Del 5 de septiembre al 18 de diciembre de 2014.

Información

Teléfonos: 91 3867275 / 1592

Fax: 91 3867279

<http://www.fundacion.uned.es/>

12. Responsable administrativo

Negociado de Especialización.