

Series de Tiempo

Descripción:

El curso tiene como objetivo introducir a los alumnos a los métodos y practicas relevantes para el análisis de series de tiempo. Las clases tomarán como referencia principal los primeros capítulos del libro *Time Series Analysis*, de James Hamilton.

Programa:

Clase 1: Ecuaciones en Diferencias (Capítulo 1)

Clase 2: Series de Tiempo Estacionarias (Capítulos 2 y 3)

Clase 3: Estimación de Máxima Verosimilitud (Capítulo 5)

Clase 4: Análisis de Espectro (Capítulo 6)

Clase 5: Modelos de Series de Tiempo No Estacionarias (Capítulos 15 y 16)

Clase 6: Examen

Referencias:

Hamilton, James D., *Time Series Analysis*, Princeton University Press, 1994.

Priestley, M. B., *Spectral Analysis and Time Series*, Academic Press, 1981.