



ANÁLISIS DE SERIES TEMPORALES. HERRAMIENTAS PARA LA PREDICCIÓN

DIRECTOR DEL CURSO

César Pérez López. Vocal Asesor del Instituto de Estudios Fiscales.

OBJETIVOS DEL CURSO

La temática del curso son los fundamentos y las herramientas de series temporales aplicadas al análisis económico y otros campos de interés. Sus objetivos son capacitar a los alumnos para llevar a cabo análisis de series temporales y predicción en el campo de la economía pública, así como en otros campos del conocimiento. Este curso persigue, esencialmente, estudiar, desde un punto de vista eminentemente práctico, los modelos univariantes y multivariantes de series temporales.

El objetivo esencial es el tratamiento adecuado de las series de datos con dimensión temporal haciendo hincapié en la metodología Box-Jenkins, modelos con intervención y modelos de la función de transferencia. Se tratará también la predicción mediante modelos causales con series temporales, así como técnicas modernas de cointegración en modelos de series de tiempo.

PROGRAMA

- Métodos de predicción. Tipología.
- Panorámica del software para la predicción. Software automático.
- Métodos autoproyectivos deterministas de predicción. Medias móviles y suavizados lineal, exponencial y estacional. Modelos de Holt, Brown y Winters.
- Métodos autoproyectivos estocásticos de predicción. Modelos ARIMA y metodología de Box Jenkins.
- Modelos ARIMA estacionales y generales. Identificación, estimación, diagnosis y predicción.
- Modelos con análisis de la intervención y función de transferencia.
- Aplicación a la predicción de ingresos por impuestos.
- Aplicación a la predicción de magnitudes macroeconómicas.
- Predicciones condicionales. Predicción mediante modelos causales.
- Técnicas de cointegración en modelos con series de tiempo.
- Tratamiento en profundidad de todos los temas con los softwares: SAS, EViews, SPSS, TRAMO-SEATS y STATGRAPHICS.



PROFESORADO

César Pérez López. Vocal Asesor en el Instituto de Estudios Fiscales.

Licenciado en Ciencias Matemáticas y en Ciencias Económicas. Pertenece al Cuerpo de Estadísticos Superiores del Estado y al Cuerpo Superior de Sistemas y Tecnologías de la Información de la Administración del Estado. Ha desarrollado su actividad profesional en el Instituto Nacional de Estadística, en la Agencia de Protección de Datos y en el Instituto de Estudios Fiscales. Es Profesor Asociado en el Departamento de Estadística e Investigación Operativa III de la Universidad Complutense de Madrid con más de veinte años de experiencia docente. Es autor de un centenar de libros y artículos relativos a Matemáticas, Estadística, Economía e Informática.

Camino González Vasco. Coordinadora de Área en el Instituto de Estudios Fiscales

Licenciada en Ciencias Matemáticas por la Universidad de Oviedo y pertenece al Cuerpo Superior de Estadísticos del Estado desde el año 2004. Su carrera profesional ha transcurrido en el ámbito de la Estadística Oficial en distintos organismos públicos entre los que destacan el Instituto Nacional de Estadística, la Subdirección General de Análisis Macroeconómico y Economía Internacional en el Ministerio de Economía y el Instituto de Estudios Fiscales. Su trabajo se ha centrado fundamentalmente en los ámbitos de modelización y predicción estadística y econométrica.

FECHAS

Del 20 al 23 de mayo de 2019. En horario de 9:00 a 14:00. Aula 2.12 del Edificio A. 2ª Planta.

INFORMACIÓN Y MATRÍCULA

Instituto de Estudios Fiscales:

<http://www.ief.es/Destacados/convabierta/convabierta.vbhtml>

Avda. del Cardenal Herrera Oria, 378 – 28035 Madrid

Maribel Torres Yusta. Teléfono 00 34 91 339 54 39

maribel.torres@ief.hacienda.gob.es

COORDINACIÓN ADMINISTRATIVA DE LOS CURSOS

Teléfono 00 34 91 339 54 43

Liliana Pacheco Martínez liliana.pacheco@ief.hacienda.gob.es



PRECIO:

Coste de cada curso: 360 euros (con reducciones del 50% del importe total para funcionarios, universitarios y licenciados en paro, estudiantes de doctorado, becarios y similares siempre que acrediten dicha condición). Los funcionarios del Ministerio de Hacienda y del Ministerio de Economía y Empresa están exentos de tasas.

La matrícula definitiva al curso para los alumnos que no pertenezcan al Ministerio de Hacienda o del Ministerio de Economía y Empresa está supeditada al pago de los derechos de inscripción que se abonarán por transferencia bancaria. **El número de cuenta se facilitará en la Notificación de Admisión que será enviada a los alumnos admitidos una vez haya finalizado el proceso de selección.**

La no asistencia al curso que no haya sido notificada podrá ser causa de exclusión en posteriores adjudicaciones de cursos.