

INTRODUCCIÓN

Tema 1. Objetivos del curso.

PARTE I. ASPECTOS BÁSICOS DEL ANÁLISIS DE SERIES TEMPORALES

Tema 2. Procesos Estocásticos

- 2.1. Conceptos básicos
- 2.2. Procesos Estacionarios
- 2.3. Procesos no estacionarios

Bibliografía recomendada: Banerjee, A. et al. (1993), cap. 3; Davidson, R. y J.G. Mackinnon (1993), cap. 4; Hamilton, J. (1994), cap. 3 y 7; Hayashi, F. (2000), cap. 2; Perron, P. (1998b); White, H. (1984).

PARTE II. ORDEN DE INTEGRACIÓN DE LAS VARIABLES

Tema 3. Contrastes de raíz unitaria

- 3.1. Introducción
- 3.2. Contrastes de Dickey-Fuller
- 3.3. Contrastes de Phillips-Perron
- 3.4. Contrastes de Ng-Perron
- 3.5. Contrastes de raíz unitaria doble
- 3.6. Contrastes de raíz unitaria estacional
- 3.7. Contrastes de estacionariedad

Bibliografía recomendada: Banerjee et al. (1993), cap. 4; Hamilton, J. (1994), cap. 15 y 17; Hayashi, F. (2000), cap. 9; Maddala y Kim (1998), cap. 4; Perron, P. (1998b); Phillips y Xiao (1998).

TEMA 4. ORDEN DE INTEGRACIÓN Y PARÁMETROS CAMBIANTES

- 4.1. Introducción
- 4.2. Efecto de la omisión del cambio estructural
- 4.3. Contrastes de Perron
- 4.4. Endogeneización del periodo de cambio

4.5. Múltiples cambios

Bibliografía recomendada: Banerjee, A. et al. (1993), cap. 4; Maddala, G.S. y I. Kim (1998), cap. 13; Perron, P. (1989); Perron, P. (1998b); Phillips, P.C B. y Z. Xiao (1998).

PARTE III. COINTEGRACIÓN

Tema 5. Cointegración en modelos uniecuacionales

5.1. Introducción

5.2. Concepto

5.3. Contraste

5.4. Estimación

5.5. Inferencia

Bibliografía recomendada: Banerjee, A. et al. (1993), cap. 7; Dolado, J. J. et al. (2001); Hamilton, J. (1994), cap. 19; Hayashi, F. (2000), cap. 10; Maddala, G.S. y I. Kim (1998), cap. 5 y 6; Perron, P. (1998b);

Tema 6. Cointegración y parámetros cambiantes

6.1. Introducción

6.2. Efecto de la omisión del cambio estructural

6.3. Soluciones

Bibliografía recomendada: Dolado, J. J. et al. (2001); Gregory, A.W. y B. Hansen (1996); Maddala, G.S. y I. Kim (1998), cap. 13.

TEMA 7. COINTEGRACIÓN EN MODELOS MULTIECUACIONALES

7.1. Introducción

7.2. Método de Johansen

7.3. Inferencia

7.4. Exogeneidad

Bibliografía recomendada: Banerjee, A. et al. (1993), cap. 8; Dolado, J.J., et al. (2001); Hamilton, J. (1994), cap. 20; Hayashi, F. (2000), cap. 10; Johansen, S. (1996); Maddala, G.S. y I. Kim (1998), cap. 6.

BIBLIOGRAFÍA

Banerjee, A., J. J. Dolado, J. W. Galbraith y D. F. Hendry (1993). *Co-integration, Error Correction and the Econometric Analysis of Non-Stationary Data*. Oxford University Press.

Dolado, J.J., J. Gonzalo y F. Marmol (2001). "Cointegration", en *Companion to Theoretical Econometrics*, ed. by B.H. Baltagi, 634-654. Blackwell, New York.

Dolado, J. J., T. Jenkinson y S. Sosvilla (1990). "Cointegration and Unit Roots", *Journal of Economic Surveys*, 4, 249-273.

Dolado, J.J., J. Gonzalo y L. Mayoral (2003). "A Fractional Dickey-Fuller Test", de próxima aparición en *Econometría*.

Gregory, A.W., Hansen, B.E. (1996). "Residual-Based Tests for Cointegration in Models with Regime Shifts", *Journal of Econometrics*, 70, 99-126.

Hamilton, J. (1994). *Time Series Analysis*, Ed. Princeton University Press.

Hayashi, F. (2000). *Econometrics*. Princeton Econometric Press.

Johansen, S. (1996). *Likelihood Based Inference on Cointegration in the Vector Autoregressive Model*. Oxford University Press, Oxford, 2nd ed.

Maddala, G.S. y I. K. Kim (1998). *Unit Roots, Cointegration and Structural Change*. Cambridge University Press.

Perron, P. (1998a). *Econometrics Course*. Handouts. Boston University

Perron, P. (1998b). *Time Series Course*. Boston University.

Phillips, P.C.B. y Z. Xiao (1998). "A Primer on Unit Root Testing" *Journal of Economic Surveys*, 12(5).