



Universidad Nacional de Salta



Facultad de Ciencias Económicas,
Jurídicas y Sociales

"2018 – Año del Centenario de la Reforma Universitaria"

RES. DECECO Nº 415-18

Salta, 28 MAY 2018

EXPEDIENTE Nº 6315/18

VISTO: La nota presentada por la Cra. María Rosa Panza de Miller y el Lic. Eugenio Martínez, Profesores de Seminario de Práctica Profesional y de la asignatura Teoría Monetaria, respectivamente, para el dictado de un Seminario de Actualización sobre el tema: "INTRODUCCION AL AJUSTE ESTACIONAL CON JDEMETRA", para alumnos de la carrera de Licenciatura en Economía, Plan de Estudios 2003, de Sede Salta, y;

CONSIDERANDO:

Que la normativa a seguir para el dictado de Seminarios de Actualización es establecida por la Resolución Nº 399/07, que reglamenta los mismos para el Plan de Estudios 2003.

Que a fs. 6, del expediente de referencia, obra Despacho Nº 160/18 de la Comisión de Docencia con dictamen favorable.

Que por Resolución Nº 420/00 y su modificatoria la Resolución Nº 718/02, el Consejo Directivo delega en el Señor Decano de la Facultad, la aprobación de Programas Analíticos y de Examen, Bibliografía, Régimen de Promoción, trámite de Equivalencias y Seminario de Actualización que cuenten con dictamen favorable de la Comisión de Docencia.

POR ELLO: en uso de las atribuciones que le son propias;

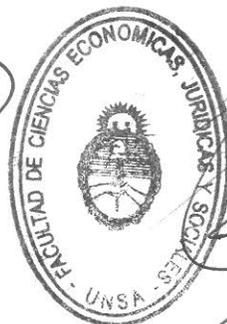
**EL DECANO DE LA FACULTAD DE CIENCIAS ECONÓMICAS,
JURÍDICAS Y SOCIALES
RESUELVE:**

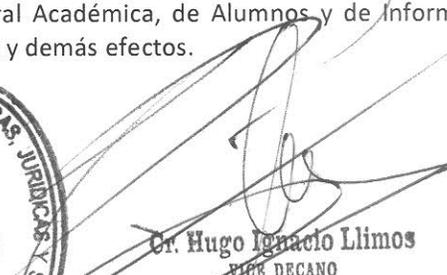
ARTÍCULO 1º- APROBAR la propuesta presentada por la Cra. María Rosa Panza de Miller y el Lic. Eugenio Martínez, Profesores de Seminario de Práctica Profesional y de la asignatura Teoría Monetaria, respectivamente, para el dictado de un Seminario de Actualización sobre el tema: "INTRODUCCION AL AJUSTE ESTACIONAL CON JDEMETRA", para alumnos de la carrera de Licenciatura en Economía, Plan de Estudios 2003, de Sede Salta, cuyas especificaciones obran en el Anexo I de la presente Resolución.

ARTÍCULO 2º - HÁGASE SABER a la Cra. María Rosa Panza de Miller y al Lic. Eugenio Martínez, al Departamento de Economía, a la Direcciones General Académica, de Alumnos y de Informática y al C.E.U.C.E, y demás interesados para su toma de razón y demás efectos.

ahl
R
eo


Cr. Diego Sibello
Secretario As. Institucionales y Administrativo
Fac. Cs. Econ. Jur. y Soc. - UNsa




Cr. Hugo Ignacio Llimos
VICE DECANO
Fac. Cs. Econ. Jur. y Soc. - UNsa



ANEXO I - RES. DECECO Nº 415-18

Seminario de Actualización:
"INTRODUCCION AL AJUSTE ESTACIONAL CON JDEMETRA"

Fundamentación de la propuesta:

El ajuste estacional (AE) de una serie de tiempo de frecuencia mayor a la anual (mensual, trimestral, etc), conforma una parte esencial de los distintos procesos que se llevan a cabo en los organismos de estadísticas, bancos centrales y demás instituciones relacionadas. Las diferentes metodologías desarrolladas se enfocan en estimar y remover los movimientos estacionales y los relacionados con el calendario (efecto pascuas, días laborales, feriados, etc) Esta remoción o AE resulta de una serie de tiempo ajustada estacionalmente, la cual presente una clara lectura del fenómeno económico bajo estudio.

Por dichos motivos, se considera a este curso como uno de alta importancia, para brindar a los potenciales asistentes de un conjunto de herramientas fundamentales para el análisis correcto de series económicas y cualquier análisis de coyuntura que deseen llevar a cabo.

Objetivo General:

Brindar los conocimientos y herramientas básicas a los alumnos avanzados de la Facultad para que logren aprender el manejo básico aplicado del software JDEMETRA para llevar a cabo un análisis completo de descomposición y ajuste estacional de una serie de tiempo económica.

Objetivos Específicos:

- Llevar a cabo la descomposición de una serie de tiempo y analizar sus distintas componentes.
- Comprender los métodos de AE utilizados por X13-ARISMA-SEATS(X-13)
- Obtener la capacidad básica de utilizar el software libre JDEMETRA para un AE
- Aprender a interpretar los diversos outputs obtenidos de los procedimientos e AE llevados a cabo por X-13 a través de la aplicación del software JDEMETRA

Una vez completado el seminario, los participantes estarán en una posición de saber elegir las opciones más apropiadas del X-13 por medio del software JDEMETRA y sabrán valorar e interpretar los resultados obtenidos.

Contenidos:

- Introducción: visión general, objetivo del ajuste estacional, definición de estacionalidad.
- Jdemetra: una nueva herramienta de código abierto para el ajuste estacional.
- Sección de X11, Principio básico y otras cuestiones. X-13-ARIMA-SEATS por medio de JDEMETRA: estructura, gestión de datos, instalación, configuración, herramientas adicionales. Ejemplos: ajuste estacional de caja negra, selección automática de filtros.
- Petratamiento de Reg ARIMA: marco del modelo básico, ecuación de regresión, valores atípicos, efectos calendario.
- Pretratamiento de RegARIMA: fundamentos de las series de tiempo, ecuación ARIMA. Ejemplos: valores atípicos, efectos calendario, identificación automática del modelo AROMA. Ejemplos: personalización del usuario, series de tiempo presentadas por los participantes.
- Control de calidad: pruebas de existencia de estacionalidad, estadísticas M y Q, herramientas gráficas.





Universidad Nacional de Salta



Facultad de Ciencias Económicas,
Jurídicas y Sociales

"2018 – Año del Centenario de la Reforma Universitaria"

415-18

- JDemetra en la práctica: ajuste estacional basado en el modelo ARIMA, Ajuste estacional agregado: enfoque directo vs. indirecto. Ejemplos: Series de tiempo agregadas, casos problemáticos. Políticas de Revisión.

Bibliografía:

- ENDERS, W. (2010). "Applied Econometric Time Series". 3rd Edition. John Wiley & Sons, Inc. Hoboken, New Jersey.
- EUROSTATS (2017). "JDemetra: Software & full Documentation"
- JORRAT, J. (2003) "Indicador Económico Regional: EL índice Mensual de Actividad Económica de Tucumán (IMAT)". Anales de Asociación Argentina de Economía Política, XXXVIII Reunión Anual. Mendoza.
- JORRAT, J; SAL PAZ, L; CATALAN, M (2002) "Ajuste Estacional de las Series Económicas de Argentina". Anales de la Asociación Argentina de Economía Política.
- LADIRAY, D; QUEMMEVILLE, B (2000/1) "Desestacionalizar con el Método X11". Methodologica, Nº 8 -9

Carga Horaria:

Los contenidos se desarrollarán en 6(seis) clases de 3(tres) horas cada una. Total Horas: 18 (dieciocho)

Docentes a cargo:

Lic. H. Eugenio Martínez
Lic. Luis Mauri

Recursos:

Recursos Humanos: los docentes y los asistentes al curso.

Recursos Físicos: - Proyector Multimedia

-Pizarrón y marcadores de colores y borrador.

- Laptop

Material Didáctico:

- Artículos de revistas técnicas (journals) vinculados a la temática del curso.
- Guías de estudio y guías de lectura.

Sistema de Dictado:

Para el dictado del seminario se utilizará la metodología del sistema de workshop donde va a primar por un lado, la clase magistral y luego, un trabajo de entrenamiento-aprendizaje entre los alumnos y los profesores de una forma altamente activa.

Sistema de Evaluación:

Se requiere un mínimo de asistencia del 80% sobre el total de clases. La evaluación del curso se llevará a cabo mediante la realización y análisis interpretativo por parte de los asistentes de un caso de ajuste estacional completo utilizando alguna serie temporal relacionada con la coyuntura económica de la provincia de Salta.

Destinatarios:

Alumnos de la carrera de Licenciatura en Economía, Plan de Estudios 2003, que tengan aprobada Econometría I.



[Handwritten signature]