

Plan 246 Lic. en Economía

Asignatura 43715 ANALISIS DE COYUNTURA Y CICLOS ECONOMICOS

Grupo 1

Presentación

Técnicas de extracción del componente cíclico y análisis de coyuntura. Características cíclicas de las economías desarrolladas. Perturbaciones y mecanismos de propagación. Modelos de equilibrio competitivo. Modelos de competencia imperfecta. Transmisión internacional de los ciclos.

Programa Básico

TEMA 1 - MODELOS DE SERIES DE TIEMPO
TEMA 2 – EXTRACCION DE SEÑALES
TEMA 3 – METODOS ESPECIFICOS PARA EXTRAER EL COMPONENTE CICLICO
TEMA 4 – LOS INFORMES DE COYUNTURA
TEMA 5 – INTRODUCCION A LOS CICLOS ECONOMICOS
TEMA 6 – LA TEORIA CLASICA DEL CICLO
TEMA 7 – LA TEORIA DEL CICLO REAL
TEMA 8 – LA NUEVA ECONOMIA KEYNESIANA

Objetivos

Se trata de un enfoque eminentemente aplicado, presentando los materiales teóricos junto con su aplicación a casos reales. Objetivos concretos:

- Comprender los métodos estadísticos utilizados en los informes de coyuntura.
- Familiarizarse con la estructura y los contenidos de estos informes.
- Desarrollar la capacidad de utilizar modelos para explicar los movimientos de las variables a lo largo del ciclo.
- Los alumnos deben aprender a elaborar un texto en el que expresen de forma rigurosa sus ideas, y sean capaces de expresarlas con claridad y consistencia en público.

Programa de Teoría

PARTE I ANALISIS DE COYUNTURA

TEMA 1 - MODELOS DE SERIES DE TIEMPO

- 1.1. El enfoque estocástico
- 1.2. Modelos ARMA
- 1.3. Procesos no estacionarios

TEMA 2 – EXTRACCION DE SEÑALES

- 2.1. Componentes de una serie temporal
- 2.2. Métodos empiricistas
- 2.3. Métodos basados en modelos

TEMA 3 – METODOS ESPECIFICOS PARA EXTRAER EL COMPONENTE CICLICO

- 3.1. Tasas de crecimiento
- 3.2. Filtro de Hodrick-Prescott
- 3.3. Filtro de bandas

TEMA 4 – LOS INFORMES DE COYUNTURA

- 4.1. Objetivos
- 4.2. Estructura
- 4.3. Fuentes de información

PARTE II LOS CICLOS ECONOMICOS

TEMA 5 – INTRODUCCION A LOS CICLOS ECONOMICOS

- 5.1. Panorámica del análisis del ciclo económico
- 5.2. Caracterización del ciclo económico
- 5.3. Hechos estilizados

TEMA 6 – LA TEORIA CLASICA DEL CICLO

- 6.1. Modelo determinista
- 6.2. Expectativas racionales
- 6.3. Modelo de Lucas: información imperfecta

TEMA 7 – LA TEORIA DEL CICLO REAL

- 7.1. Perturbaciones transitorias y permanentes
- 7.2. Modelo básico RBC
- 7.3. Calibración y simulación

TEMA 8 – LA NUEVA ECONOMIA KEYNESIANA

- 8.1. Introducción
 - 8.2. Competencia imperfecta y fijación de precios.
 - 8.3. La nueva curva de Phillips.
 - 8.4. Modelo completo.
-

Programa Práctico

Se dedicará al menos un día a la semana a prácticas, la mayoría en las aulas de informática. Los tipos de prácticas a realizar son:

- manejo de fuentes estadísticas (nacionales e internacionales, en diversos soportes),
 - tratamiento de series con el EViews,
 - revisión de informes de coyuntura de diversas instituciones (Banco de España, INE, etc.),
 - cálculo de características cíclicas de varios países,
 - simulación de algunos modelos con EXCEL o MATLAB.
-

Evaluación

El 80% de la nota se obtendrá mediante la elaboración y presentación en clase de dos trabajos, y el resto de la nota se obtendrá por la asistencia y participación en clase.

Bibliografía

ESPASA, A. y CANCELO, J. R. (1993): Métodos cuantitativos para el análisis de la coyuntura económica. Ed. Alianza. Madrid.

ROMER, David (2004): Macroeconomía Avanzada, McGraw-Hill, 2ª edición.
