



Descriptivo

Estimación y Análisis de Cortes Transversales y Series de Tiempo en EViews

Descripción:

La modelación econométrica es una herramienta de gran utilidad en el análisis descriptivo e inferencial de la información. Los cortes transversales permiten establecer relaciones y revisar causalidades y determinantes para una variable de estudio; los modelos de probabilidad permiten establecer la posibilidad de ocurrencia de un evento como por ejemplo que una persona pague sus obligaciones o entre en default; y los modelos de series de tiempo son indispensables para el pronóstico de cifras. A lo largo del entrenamiento se revisarán algunos conceptos relevantes para la comprensión de las técnicas descritas y su implementación en EViews, uno de los mejores paquetes presentes en el mercado para la modelación econométrica, a través de ejemplos y casos prácticos.



Dirigido a:

Directores, analistas, profesionales, y en general a todas las personas que por su labor estén interesadas en repasar algunos conceptos de modelación de series de tiempo y su implementación en EViews.



Objetivo:

Repasar los conceptos mínimos necesarios para el análisis y estimación de modelos de corte transversal y de series de tiempo. Mostrar la implementación de los modelos a través de ejemplos en EViews. Interpretar los estadísticos y resultados generados por EViews para el análisis y toma de decisiones.



Temario:

Introducción a EViews

Inicio y ventanas

Ayuda

Worfiles

Revisión de Varias Series

Gráficos

Menú Quick

Modelos de Cortes Transversales

Regresión lineal y MCO

- Estimación de parámetros
- Interpretación de parámetros
- Validación de los supuestos del modelo
- Modelos con información cualitativa (variables dummy)

Regresión con variables dependientes binarias

- Modelo lineal de probabilidad
- Modelo Logit
- Modelo Probit
- Interpretación de resultados: tablas de clasificación

Modelos de series de tiempo

Pronóstico con series de tiempo

- Componentes de una serie de tiempo
- Métodos de suavizamiento
- Medidas de precisión de pronóstico

Estacionariedad

- Concepto e importancia
- Prueba gráficas: línea y correlogramas
- Diferenciación
- Pruebas de raíz unitaria
- Intercepto
- Tendencia
- Rezagos
- Valores críticos

Modelos ARIMA

- Metodología Box-Jenkins
- Estimación y validación de parámetros
- Validación de supuestos (ruido blanco)
- Pronósticos



Instructores: