



Descriptivo

Estimación y Análisis de Modelos Univariados de Cortes Transversales y Series de tiempo en EViews. Básico e Intermedio Autor: Julián Meléndez

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

Revisión detallada a la validación de los supuestos

-Valor esperado condicional igual a cero

-Linealidad

-Casos influyentes

-Variables omitidas

-Multicolinealidad

-Heterocedasticidad

-Autocorrelación

-Estimación, Stepwise (Forward, Backward)

Regresión con Variables Dummy

Análisis de Varianza

Análisis de Covarianza

Interacción de Variables

Quiebres Estructurales

Regresión con Variables Dependientes Binarias

Modelo lineal de Probabilidad

Modelo Logit

Modelo Probit

Predicción de Probabilidades

Validación del Modelo

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

-Médidas 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)

Pronóstico Dinámico y Estático

Modelos que incorporan Volatilidades

Volatilidad Variable en el Tiempo

Prueba para Efectos ARCH

Estimación ARCH/GARCH



Instructores: