

Entrenamiento Especializado

Manejo de Series de Tiempo con EViews

Descripción

Entrenamiento especializado presencial con repaso conceptual y aplicaciones en EViews para el tratamiento de series de tiempo. Se realizará una exposición magistral por parte del instructor, y se desarrollarán ejercicios en clase para consolidar los conocimientos adquiridos.

Dirigido a

Directores, profesionales, analistas, docentes e investigadores que en sus labores requieran de la utilización de métodos estadísticos y econométricos.

Objetivo

El objetivo primordial es presentar al participante las diferentes aproximaciones tanto teóricas como prácticas para el tratamiento de series de tiempo y de una manera muy simple realizar un análisis de manejo de datos, apoyados con EViews, una de las más poderosas herramientas de software para tal fin.

Temario

1. Workfile y Manejo de Datos:

- Creación de Workfiles
- Importación / Exportación de Datos
- Lectura de Datos de EViews con otras Aplicaciones
- Importación de Archivos ASCII
- Cambio de Tamaño de un Workfile

2. Teoría Económica de los Modelos de Series de Tiempo:

- Estacionariedad y Conceptos Previos
- Componentes de una Serie de Tiempo
- Descomposición de una Serie de Tiempo (Uso de Filtros)
- Metodología de Modelación de Holt- Winters

3. Manejo y Análisis de Series de Tiempo:

- Modelos Univariantes: AR, MA, ARMA
- Análisis de las Funciones de Autocorrelación Simple y Parcial
- Estacionalidad
- Modelos Integrados
- Raíces Unitarias

4. Modelos ARIMA y VAR - VEC, Causalidad:

- Metodología de Box Jenkins
- Casos Aplicativos de Modelos ARIMA en Economía y Finanzas
- Modelos Multivariantes: VAR (Causalidad de Granger, Impulso Respuesta y Descomposición de Varianza)

¿Qué es la Cointegración?

Metodologías de Cointegración (Engel-Granger y Johansen)

Vector de Corrección de Errores

5. Modelos de Heteroscedasticidad Condicional:

Modelos ARCH

Modelos GARCH

Aplicaciones Financieras

Instructores

Fernando Jáuregui Puertas

Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos CRM, impartida con el Dr. Jonathan Mun. Profesional en Ciencias Económicas de la Universidad Nacional de Ingeniería del Perú. Executive Master in Financial Analysis en la Universidad Carlos III de Madrid (España). Adicionalmente, cuenta con especialización en Gestión de Riesgos Financieros en BURSEN (Centro de Estudios Bursátiles de la Bolsa de Valores de Lima) y en Formulación y Evaluación de Proyectos de Inversión Pública en la Universidad ESAN. Actualmente es docente de la Maestría en Finanzas de la Universidad del Pacífico (Perú) e instructor de SOFTWARE shop para LATAM. Tiene experiencia en el sector público como Analista de Proyectos de Inversión y en el Sector Bancario como Analista de Estudios Económicos. Anteriormente se desempeñó como docente de la Facultad de Ingeniería Económica de la Universidad Nacional de Ingeniería (Perú), en las asignaturas de Econometría II y Análisis de Series Temporales.

Información General

Duración

16 horas

Fecha de Inicio

Sáb. 21 de Jun de 2014

Horarios

Fechas:

Sábado 21 y 28 de Junio del 2014

Hora:

8:30 a 12:30 y de 14:00 a 18:00

Ciudad

Lima (Lima, Perú)

Lugar:

Universidad Peruana de Ciencias Aplicadas Sede Isidro

Herramientas de apoyo

EViews®

Mayores informes de inscripción y costos

Entrenamientos@Software-Shop.com

Políticas

Para conocer en detalle las condiciones y políticas de participación en los eventos, ingrese a nuestro link

<https://www.software-shop.com/formacion/politicas>

Inscríbete ahora