

Entrenamiento Especializado

Entrenamiento Online: Series de Tiempo No Estacionarias y Series de Tiempo Multivariadas en EViews.

Descripción

Uno de los requisitos importantes para la elaboración de estimaciones fuera de muestra (pronósticos) es la estacionariedad en la serie. Cuando esta premisa no es verificable podemos recurrir a los conceptos de Cointegración y Vector de Corrección de Errores. Por otro lado una series de tiempo en “solitario” -univariada- no siempre genera los modelos con el mejor ajuste. A veces, considerar más de dos series en la estimación puede generar mejores modelos para el pronóstico. Éste es el ámbito de los Vectores Autorregresivos (VAR).

Dirigido a

Directores, Analistas, Profesionales, Académicos, Investigadores y en general a todas las personas interesadas en una introducción a la modelación de series de tiempo no estacionarias y series de tiempo multivariadas.

Objetivo

Dar una perspectiva general de la modelación de series de tiempo no estacionarias y de los modelos multivariados. Dar a conocer diversas pruebas y metodologías de estimación y ámbitos de aplicación. Introducir los conceptos teóricos con ejercicios prácticos desarrollados por los participantes.

Temario

1. Repaso del modelo autorregresivo univariado – AR(p)
 - a. Estimación
 - b. Ruido blanco – Prueba Ljung-Box (Estadístico Q)
 - c. Correlograma
 - d. Principio de parsimonia
2. Vector Autorregresivo en forma reducida – VAR(p)
 - a. Ventajas y limitaciones
 - b. Estimación
 - c. Validación
 - d. Pronóstico
 - e. Bondad de ajuste
 - f. Función impulso-respuesta
 - g. Prueba de causalidad de Granger/Exogeneidad de Wald
 - h. Extensiones: S-VAR y VAR-X
3. Pruebas de raíz unitaria
 - a. Estacionariedad
 - b. Estacionalidad
 - c. Regresión espuria
 - d. Prueba Phillips-Perron (PP)

- e. Prueba Dickey-Fuller (DF)
 - f. Prueba Dickey-Fuller Aumentada (ADF)
 - g. Prueba Kwiatowski-Phillips-Schmidt-Shin (KPSS)
 - h. Quiebres estructurales
 - i. Mención a modelos no lineales de series de tiempo (TAR, SETAR, STAR y MSW)
4. Cointegración univariada
- a. Teorema de la representación de Granger
 - b. Engle-Granger
 - i. Identificación
 - ii. Propiedad de superconsistencia
 - iii. Estimación de la relación de corto plazo
 - iv. Estimación de la relación de largo plazo
 - v. Interpretación
 - c. Phillips-Ouliaris
5. Cointegración multivariada: Vector de corrección de error – VECM
- a. Metodología de Johansen
 - b. Prueba traza
 - c. Prueba del máximo eigenvalor (valor propio)
6. AR(p) y VAR(p) en diferencias
- a. Raíces unitarias no cointegradas
 - b. S-VAR vs. VECM
7. Resumen

Instructores

Laura Juliana Vargas Rueda

Economista con énfasis en métodos cuantitativos y magister en economía de la Pontificia Universidad Javeriana en Colombia. Actualmente se desempeña como docente de cátedra de esta misma Universidad y como Consultora independiente. Dentro de su experiencia laboral ha hecho parte de empresas consultoras como Datos procesos y tecnología DPT SAS y Oportunidad Estratégica Ltda. Donde se desempeñó como Economista de Apoyo y Coordinadora del grupo de investigación registrado en CONCIENCIAS "Economía Ecológica", y coordinadora de propuestas respectivamente. Adicionalmente hizo sus prácticas en el Banco de la República de Colombia en el Departamento de Modelos Macroeconómicos. Experiencia en el manejo de software como Stata, Eviews y Matlab

Información General

Duración

16 horas

Fecha de Inicio

Mar. 03 de Mar de 2015

Horarios

Fechas:

Marzo 3, 5, 7, 10 y 12 de 2015

Horarios Martes y Jueves**Hora de inicio por país**

San José de Costa Rica 3:00 p.m

México 3:00 pm

Bogotá 4:00 pm

Lima 4:00 p.m.

Quito 4:00 p.m.

Bolivia 5:00 p.m.

Santiago de Chile 6:00 p.m.

Buenos Aires 6:00 p.m.

Horario Sábado:

San José de Costa Rica 8:00 a.m

México 8:00 a.m

Bogotá 9:00 a.m

Lima 9:00 a.m.

Quito 9:00 a.m.

Bolivia 10:00 a.m.

Santiago de Chile 11:00 a.m.

Buenos Aires 11:00 a.m

Herramientas de apoyo

EViews[®]

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