

Entrenamiento Especializado

Análisis de Series de Tiempo y Datos Panel con Stata.

Descripción

El entrenamiento aborda desde un enfoque sencillo y práctico las diferentes técnicas y herramientas que ofrece STATA en el manejo de información, así como su análisis e interpretación de resultados. Utilizando un metodología teórica se abordarán los contenidos, acompañados de una serie de ejercicios y talleres prácticos en clase. Así mismo, se dejarán algunos ejercicios para realizar fuera del aula con los cuales se busca lograr una mayor profundización y práctica de los temas tratados a lo largo del desarrollo del entrenamiento.

Dirigido a

Directores, Analistas, Docentes e Investigadores de los sectores público o privado, que en sus labores requieran de la implementación de Stata.

Objetivo

1. Lograr que los asistentes aprovechen al máximo las ventajas de STATA como herramienta especializada en el análisis de datos, estimación, pronóstico de la información y profundización en conceptos básicos estadísticos, financieros y econométricos, aplicando el uso de la herramienta. 2. Plantear soluciones a problemas de orden estadístico, económico y financiero apoyados en datos de panel y datos de series de tiempo. 3. Mejorar habilidades en el manejo y administración de bases de datos.

Temario

Manejo de Datos de Series de Tiempo y Panel

Se realizará una introducción al manejo de datos en formato Series de Tiempo y Panel utilizando algunos ejemplos, posteriormente un Análisis Descriptivo e Inferencial.

Introducción al Manejo de Datos de Series de Tiempo

- Formatos de Tipos de Variables de Fecha.
- Comandos Útiles para describir Series Temporales.
- Operadores de Series de Tiempo.
- Gráficos de Series Temporales.

Introducción a los Datos de Panel y sus Características

- Construcción de Bases de Datos Tipo Panel
- Estadísticas Descriptivas y Gráficos en Datos de Panel (Gráficos de Dispersión Múltiples)
- Conceptos Básicos de Estimaciones de Panel

Modelos de Regresión

Se realizará una introducción al planteamiento teórico de la Regresión por medio de ejemplos y explicará la metodología para la realización del procedimiento

usando Stata, así mismo la verificación de supuestos en:

- Análisis de Datos y Diagramas de Dispersión.

- Estimación de la Matriz de Correlación entre Variables
- Estimación del Modelo Estándar de Regresión Lineal (Simple y Múltiple)
- Pruebas de Hipótesis sobre los Parámetros (Test)
- Tablas de Resultados de varias Regresiones
- Pronósticos
- Revisión de los supuestos del Modelo MCO: Multicolinealidad, Heteroscedasticidad y Normalidad.

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
- Modelos Univariantes: AR, MA, ARMA
- Análisis de las Funciones de Autocorrelación Simple y Parcial
- Estacionalidad
- Modelos Integrados
- Raíces Unitarias
- Aproximación Box Jenkins
- Especificación de un Modelo ARIMA
- Estimación
- Diagnóstico del Modelo
- Pronóstico con Modelos ARIMA
- Comparación de Pronósticos
- Análisis de Intervención.
- Valores Atípicos

VAR - VEC, Causalidad:

- 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

Modelos de Heteroscedasticidad Condicional:

- ARCH: Un Modelo de la Volatilidad Variable en el Tiempo
- Extensiones al Modelo ARCH
- GARCH: Limitar el Orden del Modelo
- Otras Extensiones
- Respuestas Asimétricas a “Noticias”
- Las Variaciones en la Volatilidad afectan a la media de la Serie Observable
- Errores No Normales
- Probabilidades y Extremos

Manejo de Datos Panel

Estimación de datos por efectos fijos y efectos aleatorios, así mismo se mostrarán comandos adicionales para el manejo de éste tipo de datos.

Introducción a los Datos de Panel y sus Características

- Construcción de Bases de Datos tipo Panel
- Estadísticas Descriptivas y Gráficos en Datos de Panel (Gráficos de Dispersión Múltiples)
- Conceptos Básicos de Estimaciones de Panel

Efectos Fijos y Aleatorios

- Modelos de Efectos Fijos
 - Estimadores Intra y entre Grupos
 - Efectos Fijos de Grupo y de Tiempo
- Efectos Aleatorios
 - Métodos de Estimación
 - Contraste de Efectos Aleatorios
 - Eligiendo entre Modelos de Efectos Fijos y Efectos Aleatorios

Instructores

Mario Antonio Vera Delgado

Especialista Certificado Next-Gen, Ingeniero Comercial, Licenciado y Magíster en Economía de la Universidad de Concepción en Chile. Actualmente se desempeña como Analista Senior de la Dirección General de Estudios de la Comisión para el Mercado Financiero de Chile y como docente de economía en la Universidad Santo Tomás sede Santiago y para el Diplomado en Análisis de Datos Estadísticos Sociales de la Pontificia Universidad Católica en su país.

Eduardo Antonio Valdebenito Durán

Doctor en Física y Magíster en Economía Aplicada MAGCEA de la Universidad de Chile. Actualmente se desempeña como analista de la Unidad de Riesgos de la Dirección de Estudios y Análisis Financiero de la Superintendencia de Bancos e Instituciones Financieras de Chile.

Información General

Duración

20 horas

Fecha de Inicio

Lun. 25 de May de 2015

Horarios

Lugar:

Tecnobit

Avda. Seminario No. 10 Providencia

Fechas:

Mayo 25 al 29 de 2015

Horarios:

De 9:00 a.m. a 13:00

Ciudad:

Santiago de Chile

Ciudad

Santiago de Chile (Metropolitana, Chile)

Lugar:

SOFTWARE shop - Santiago de Chile

Herramientas de apoyo



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