

# Entrenamiento Especializado

## Entrenamiento Especializado en 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

Brayan Ricardo Rojas Ormaza, Mag.

Economista, especialista en gestión de riesgos financieros y magister en finanzas, cuenta con la certificación CQRM y la certificación Financial Risk Management (FRM). Actualmente es el líder del área de consultoría y auditoría de gestión de riesgos financieros de KPMG Colombia desempeñándose como Gerente Senior, ha sido gerente de consultoría en KPMG Panamá. Se desempeñó como jefe de riesgo de mercado y liquidez en el Banco Mundo Mujer y en áreas de riesgo y tecnología en Banco de Bogotá, Banco Davivienda y Software Shop. Cuenta con amplia experiencia en construcción, modelación, revisión, auditoría y asesoría de modelos de gestión de riesgo de mercado, crédito, operacional y liquidez en entidades financieras y no financieras con el uso de herramientas cuantitativas y cualitativas.

## Información General

### Duración

16 horas

### Fecha de Inicio

Mar. 21 de Jul de 2015

### Horarios

**Fechas:** Julio 21, 22, 23, 25, 28, 29 y 30 de 2015.

**Intensidad horaria:** Martes, miércoles y jueves - sesiones de 2 horas. Sábado sesión de 4 horas.

#### Hora de inicio por país

San José de Costa Rica 5:00 p.m

México 6:00 pm

Bogotá 6:00 pm

Lima 6:00 p.m.

Quito 6:00 p.m.

Bolivia 7:00 p.m.

Santiago de Chile 8:00 p.m

Buenos Aires 8:00 p.m.

#### Hora inicio Sábados según país:

San José de Costa Rica 8:00 a.m

México 9:00 a.m

Bogotá 9:00 a.m

Lima 9:00 a.m.

Quito 9:00 a.m.

Caracas 9:30 a.m

Bolivia 10:00 a.m

Santiago de Chile 11:00 a.m

Buenos Aires a:m 11:00 a.m

## Herramientas de apoyo

# EViews® 11

## 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