

# Entrenamiento Especializado

## Entrenamiento Especializado en Modelos Económicos de Series de Tiempo en EViews

### Descripción

La modelación econométrica de series de tiempo univariadas y multivariadas es una herramienta de gran utilidad para el pronóstico de variables numéricas y es relevante para cualquier disciplina o actividad que estudie la evolución de las mismas en el tiempo. 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, docentes, investigadores y en general a todas las personas que por su labor estén interesadas en repasar e implementar los principales conceptos de modelos de series de tiempo.

### Objetivo

- Repasar los conceptos mínimos necesarios para el análisis y estimación de modelos de series de tiempo univariados y multivariados.
- 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
- Workfiles
- Revisión de Varias Series
- Gráficos
- Menú Quick

#### Introducción a los pronósticos

- Componentes de una serie de tiempo
- Condiciones para realizar pronósticos cuantitativos
- Promedios móviles (simples y dobles)
- Métodos de suavizamiento (simples, dobles, Holt-Winters)
- Medidas de precisión de pronóstico

#### Conceptos básicos de series de tiempo

- Procesos estocásticos y estacionariedad
- Identificación de la estacionariedad (gráfico, correlograma)

- Pruebas de estacionariedad (raíz unitaria)

### **Regresión con variables de series de tiempo**

Con variables estacionarias

- Con variables no estacionarias: regresión espuria
- Con variables no estacionarias: cointegración
- Con variables cointegradas: modelo de corrección de errores
- Con variables no estacionarias y no cointegradas

### **Modelos univariados de series de tiempo**

Metodología Box-Jenkins (Modelos ARIMA)

Identificación, estimación, validación y pronóstico

Criterios de información

- Modelos ARIMA automáticos
- Promedio de pronósticos (unificación de los resultados de varios modelos)
- Modelos que incorporan volatilidades: ARCH y GARCH

### **Modelos multivariados de series de tiempo**

- Vector de Corrección de Errores (VEC)
- Vectores Autorregresivos (VAR)
- Impulso-respuesta
- Descomposición de la varianza

## **Instructores**

### **Julián Andrés Meléndez Cardona**

Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgo - CQRM, impartido por el Dr. Johnathan Mun y otorgado por el Instituto IIPER. Economista con Especialización en Gerencia de Mercadeo de la Universidad Externado de Colombia. Cuenta con amplia experiencia en temas de Valor de Dinero en el Tiempo y en Análisis y Planeación Financiera de entidades en los sectores Financiero y Real. En el campo académico trabajó como docente en temas de Econometría y Finanzas en la Universidad Externado de Colombia y en la Fundación Universitaria Los Libertadores. Actualmente se desempeña como Gerente de Producto del Portafolio Cuantitativo de SOFTWARE shop para Latinoamérica.

## **Información General**

### **Duración**

18 Horas

## Fecha de Inicio

Mar. 20 de Jun de 2017

## Horarios

### Fechas:

**Junio 20,21,22,27,28 y 29 de 2017**

### Duración:

18 Horas

Cada sesión de tres horas

### Hora de inicio por país

16:00 San José de Costa Rica

17:00 Ciudad de México, Bogotá, Lima, Quito

17:30 Caracas

18:00 la Paz, Santiago de Chile

19:00 Buenos Aires



## 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