

Webcast

Introducción a la Modelación de Series de Tiempo Multivariadas

Descripción

Este taller le permitirá al participante entender el proceso que se debe realizar para modelar series de tiempo multivariadas en específico metodologías como VAR y VEC.

Dirigido a

Investigadores, Docentes y Estudiantes que estén interesados en las metodologías multivariadas de series de tiempo Vectores Autorregresivos (VAR) y Mecanismo de Corrección de Errores (VEC).

Objetivo

Introducir al participante en la modelación de series de tiempo multivariada con modelos VAR y VEC

Temario

Introducción a la Modelación Multivariada de Series de Tiempo
Pruebas de Raíz Unitaria
Vectores Autorregresivos VAR(p)
Determinar el orden de rezagos necesarios para realizar la modelación
Validación del Modelo: Correlograma y Prueba de Portmanteau
Función de Impulso y Respuesta
Pronóstico de Series de Tiempo
Metodología de Johansen para detectar cointegración en las series
Modelo de Corrección de Errores VEC

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.

Instructor de econometría y riesgo en Software Shop para Latinoamérica, economista de la Universidad de la Salle, con Maestría en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Villanueva en Madrid-España, actualmente está cursando la Maestría en Finanzas Cuantitativas en la Universidad del Rosario en Colombia. Se ha desempeñado como profesor de estadística, toma de decisiones y econometría financiera en especializaciones y maestrías en varias Universidades de Colombia, como: CESA, Universidad del Norte, Universidad del Rosario, Universidad EAFIT, Universidad Piloto y Universidad Jorge Tadeo Lozano. Ha impartido entrenamientos especializados en materia de análisis de riesgos en entidades internacionales como: Comisión Nacional de Acreditación (Chile); Ministerio de Economía y Finanzas del Perú, OSITRAN, Organismo de Evaluación y Fiscalización Ambiental del Perú (Perú); Banco Económico de Bolivia, Banco Fossil S.A., Universidad Privada de Santa Cruz (Bolivia); Superintendencia de Industria y Comercio, Fondo Nacional del Ahorro, Grupo Saludcoop, La Equidad Seguros, FINDETER S.A., Bolsa de Valores de Colombia, Cámara Colombiana de Infraestructura, Universidad EAFIT, Fundación Universidad de América (Colombia); Banco Central de Costa Rica, Banco Popular y de Desarrollo Comunal de Costa Rica (Costa Rica).

Información General

Duración

1 Hora

Fecha de Inicio

Vie. 29 de Jul de 2016

Horarios

San José de Costa Rica 9:00 a.m

México D.F. 10:00 a.m
Bogotá 10:00 a.m
Quito 10:00 a.m
Lima 10:00 a.m
Caracas 10:30 a.m
Bolivia 11:00 a.m
Buenos Aires 12:00 m
Santiago 11:00 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