

Entrenamiento Especializado

Entrenamiento Especializado en Estimación, Validación y Pronóstico de Modelos Econométricos con el apoyo de EViews

Descripción

A lo largo del entrenamiento se revisarán conceptos relevantes para la comprensión de las técnicas de modelación econométrica, haciendo énfasis en el tipo de datos de corte transversal y de series de tiempo utilizando EViews como software de apoyo. <div>
</div><div>Se abordarán casos prácticos para mejorar la comprensión de los temas que involucra la Estimación, Validación y el Pronóstico de variables financieras y económicas. </div>

Dirigido a

Directores, analistas, profesionales, y en general a todas las personas que por su labor estén interesadas en repasar conceptos de Modelación de Series de Tiempo y su implementación en EViews.

Objetivo

- Repasar los conceptos necesarios para el Análisis y Estimación de Modelos de Corte Transversal y de Series de Tiempo.
- Mostrar la aplicación de los modelos econométricos a través de ejemplos en Eviews.
- Interpretar los estadísticos y resultados generados por Eviews para el Análisis y Toma de Decisiones.

Temario

1. Introducción al manejo de Eviews

Menú de Ayuda

Tipos de Objetos

Importación de Datos

Análisis descriptivo de la información

Gráficos relevantes para la presentación de resultados

Principales funciones matemáticas y financieras para la generación de variables.

2. Modelación de datos de Corte Transversal.

Estimación del Modelo Estándar de Regresión Lineal-MCO

Estimación de Parámetros o Interpretación de Parámetros

Revisión detallada a la validación de los supuestos

Valor esperado condicional igual a cero

Linealidad

Multicolinealidad

Heterocedasticidad

Autocorrelación

Estimación, Stepwise (Forward, Backward)

Pronóstico

3. Regresión con Variables Dummy

Análisis de Varianza
Análisis de Covarianza
Interacción de Variables

4. Regresión con Variable Dependiente Limitada

Modelo lineal de Probabilidad
Modelo Logit
Modelo Probit
Validación del Modelo
Interpretación de Resultados: (Tablas de Clasificación)
Pronóstico de Probabilidades

5. Modelos ARIMA

Estimación y Validación de Parámetros
Validación de Supuestos (Ruido Blanco)
Pronóstico Dinámico y Estático
Modelos SARIMA

6. Modelos que incorporan Volatilidades

Volatilidad condicional
Prueba para Efectos ARCH
Estimación ARCH/GARCH

7. Modelos de 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

8. Modelos que incorporan Volatilidades

Volatilidad condicional
Prueba para Efectos ARCH
Estimación ARCH/GARCH

Instructores

Miguel Ángel Bello Bernal, Mag.

Economista de la Universidad de la Salle y MBA de la Universidad Villanueva en España. Actualmente, está acreditado con la Certificación Internacional en Gestión de Riesgos-CQRM impartida por el Dr. Johnathan Mun. Consultor y formador especialista en Software Shop. Profesor de estadística, econometría y analítica de datos, a nivel de pregrado y posgrado en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) y otras universidades de Colombia. Cuenta con 7 años de experiencia como conferencista y capacitador internacional en análisis de riesgo y métodos cuantitativos para mejorar la toma de decisiones bajo escenarios de incertidumbre.

Información General

Duración

15 horas

Fecha de Inicio

Sáb. 04 de Mar de 2017

Horarios

Fechas y Horarios:

Marzo 4,11 y 18 de 2017

De 9:00 a.m. a 2:00 p.m.

Lugar:

Centro de Investigación e Información Digital (CiiD)

Planta baja del edificio C

Facultad de Ciencias Políticas y Sociales, UNAM

Av. Mario de la Cueva s/no frente a TV UNAM

Col. Ciudad Universitaria

Deleg. Coyoacán, CP 04510

Ciudad

Ciudad de México (Distrito Federal, México)

Lugar:

UNAM -

Herramientas de apoyo

EViews[®]

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