Webcast

Sesión II: Estudio de Eventos Retornos Anormales con Stata.

Descripción

El estudio de eventos es una metodología que analiza si un evento en particular tiene impacto sobre una variable de interés que podrían ser los retornos de las acciones o las variaciones en el mercado financiero mediante el análisis del comportamiento de sus precios y rentabilidades históricas. En esta presentación se mostrará de forma teórica y práctica la realización de un estudio de eventos utilizando estimaciones de datos de panel y modelos multifactoriales.

Dirigido a

El Estudio de Eventos es una metodología que analiza si un evento en particular tiene impacto sobre una variable de interés (por ejemplo, los retornos de las acciones o las variaciones en el mercado financiero) mediante el análisis del comportamiento de sus precios y rentabilidades históricas. En esta presentación se mostrará de forma teórica y práctica la realización de un estudio de eventos utilizando estimaciones de datos de panel y modelos multifactoriales.

Objetivo

Conocer y entender qué es un Estudio de Eventos.
Calcular de manera adecuada los retornos anormales y retornos brutos.
Aplicar las principales pruebas de inferencia sobre los parámetros.
Aplicar los principales procesos y rutinas de programación con Stata.

Temario

1. Conceptos iniciales: Estudio de Eventos y Retornos Anormales.
2. Manejo de Bases de Datos en Stata.
3. Estimación de MCO en una estructura de información para Datos de Panel.
4. Cálculo y Creación de la significancia estadística de los parámetros y gráficos relacionados.

Instructores

Franco Andrés Mansilla Ibañez

Especialista en entrega de soluciones analíticas a necesidades y problemáticas del negocio, tal como inversiones, operaciones y riesgos. Académico de la Universidad de Chile en cursos de Riesgo Financiero del Magíster en Finanzas y Métodos Cuantitativo en la gestión de riesgo en el diplomado de Administración de Riesgo. Sus temas de investigación son: eficiencia de mercado, riesgo financiero, machine learning y econometría.

Información General

Duración

1 hora

Fecha de Inicio

Jue. 02 de May de 2019

Horarios

4:30 p.m San José de Costa Rica
5:30 pm CDMX - Bogotá - Quito - Lima - Caracas
6:30 p.m La Paz - Santiago de Chile
7:30 p.m Buenos Aires

Herramientas de apoyo

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