

# 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