Webcast

Machine Learning en Stata. Algoritmos de Penalización y Backtesting

Descripción

En esta presentación abordaremos los criterios para seleccionar variables al momento de hacer modelos de Machine Learning o de estadística clásica, así como realizar un Backtesting que permita elegir el mejor modelo para implementar realizando un ejemplo aplicado con Stata 16.

Dirigido a

Profesionales, docentes, analistas, investigadores y estudiantes interesados en conocer y aplicar técnicas de selección de modelos y variables para aplicar un corrector backtesting.

Objetivo

Realizar una introducción a los métodos para selección de modelo y Backtesting con apoyo de Stata.

Temario

- Introducción al Machine Learning
- Método de Stepwise
- Algoritmos de penalización
- GridSearch
- K-Fold Cross Validation
- Ejercicio Práctico en Stata

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. 23 de Jul de 2020

Horarios

3:00 P.m San José de Costa Rica
4:00 pm Bogotá - Quito - Lima - CDMX
5:00 p.m La Paz - Caracas - Santiago de Chile
6:00 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