

# Econometría Intermedia con EViews

(Estimación, Validación y Pronóstico)

## 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.



Marzo 4, 11 y 18 de 2017



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



Ciudad de México

## OBJETIVOS

- 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.

## 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.

Se abordarán casos prácticos para mejorar la comprensión de los temas que involucra la Estimación, Validación y el Pronóstico de variables financieras y económicas.

## Los participantes recibirán:

- Licencia de Temporal
- Material de Trabajo en USB.
- Aula con equipos y el software instalado teniendo en cuenta que el Entrenamiento es 100% Práctico/Aplicado.
- Certificado de Asistencia

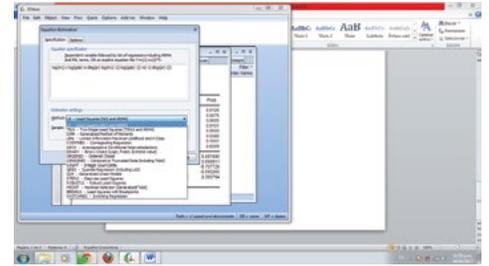
## DURACIÓN

15 Horas

## TEMARIO

### 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



### Modelación de datos de Corte Transversal

#### Estimación del Modelo Estándar de Regresión Lineal-MCO

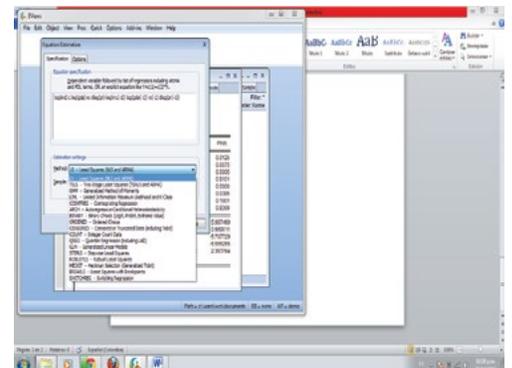
- Estimación de Parámetros o Interpretación de Parámetros
- Revisión detallada a la validación de los supuestos
- Valor esperado condicional igual a cero
- Linealidad
- Multicolinealidad
- Heterocedasticidad
- Autocorrelación
- Estimación, Stepwise (Forward, Backward)
- Pronóstico

### Regresión con Variables Dummy

- Análisis de Varianza
- Análisis de Covarianza
- Interacción de Variables

### 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

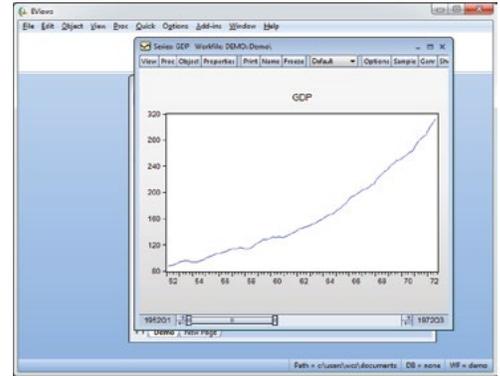


### Modelos ARIMA

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

**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



**Modelos que incorporan Volatilidades**

- Volatilidad condicional
- Prueba para Efectos ARCH
- Estimación ARCH/GARCH

**INSTRUCTOR**

“ EViews es el software líder para la manipulación de series de tiempo económicas y financieras. Su entorno, ha permitido desarrollar modelos ARIMA, SARIMA, GARCH, VAR y VEC con una alta fiabilidad y practicidad. ”



**Miguel Angel Bello Bernal**

Gerente del Portafolio de Riesgo de Software Shop para Latinoamérica. Se ha desempeñado como profesor de Estadística, Toma de Decisiones y Econometría Financiera en especializaciones y maestrías en diferentes universidades de Colombia, entre ellas: Universidad del Norte, Universidad EAFIT, Universidad del Rosario, Universidad Piloto de Colombia, Universidad Jorge Tadeo Lozano.

Es Economista de la Universidad de la Salle, cuenta con una Maestría en Administración y Dirección de Empresas de la Universidad Villanueva en Madrid-España y una Certificación Internacional en Gestión Cuantitativa de Riesgos Cuantitativos (CQRM) otorgada por el instituto iiper(International Institute of Professional Education and Research).

**MAYORES INFORMES Y COSTOS**

**José Luis Florián**

**Sector Corporativo**

[JoseLuis@SOFTWARE-shop.com](mailto:JoseLuis@SOFTWARE-shop.com)

**Tel:** +52 (555) 351 1755 **Ext:** 101 - 201

**WhatsApp:** +57 301 508 6978

**Skype:** joseluis.florian

**Claudia Sánchez**

**Sector Académico y Centros de Investigación**

[Claudia@SOFTWARE-shop.com](mailto:Claudia@SOFTWARE-shop.com)

**Tel:** +52 (555) 351 1755 **Ext:** 115 - 215

**WhatsApp:** +57 304 545 2724

**Skype:** claumarzan