

Programa en Teoría Econométrica

Series de Tiempo

El objetivo general del curso es contribuir a la formación de investigadores en las universidades del país mediante el entrenamiento en el uso intensivo de métodos estadísticos y econométricos modernos. En ese sentido, este curso es esencialmente metodológico y pondrá especial énfasis en el diseño de investigación y el uso de la econometría como herramienta para testear hipótesis económicas de interés más que en la discusión de las propiedades teóricas de estimadores. En un sentido más general, el curso pretende contribuir a cerrar las brechas en términos de formación en métodos cuantitativos que todavía existe en el país. En esa dirección, los participantes del curso serán entrenados en el uso de métodos econométricos avanzados para la identificación de efectos causales, aprenderán como implementarlos mediante el uso de software especializado como STATA y aprenderán como relacionarlos con el diseño de una investigación específica. Dado el énfasis metodológico del curso, se pondrá especial atención al trabajo con los participantes en el diseño de propuestas de investigación (más detalles syllabus adjunto).

TEMAS

Sesión I

- Análisis Espectral
- Transformada de Fourier
- Periodograma, Filtros

Sesión II

- Procesos estocásticos
- Movimientos Brownianos
- Teoría asintótica y curvas de poder

Sesión III

- Raíces unitarias
- Test de raíces unitarias ante la presencia de quiebres y outliers

Sesión IV

- Modelos ARMA, ARIMAX, SARIMAX, ARFIMA.
- Especificación y estimación
- Predicción

Sesión V

- Sistema de ecuaciones.
- VAR y SVAR

Sesión VI

- Cointegración, análisis de Engle y Granger.
- Modelos multivariados (VEC).
- ADRL.

Sesión VII

- Modelos de Volatilidad: ARCH, GARCH, SAARCH, TARCH, -
- AARCH, NARCH, EGARCH, TPARCH, PGARCH.
- Modelos de Volatilidad Condicional Multivariada (MGARCH):
- CCC, DCC, VCC, DVECH.

Sesión VIII

- Modelos Estado – Espacio (Filtro de Kalman)
- Modelos Umbral (SETAR, LSTAR, TAR).
- Modelos Markov - Switching.

Sesión IX

- Propiedades sobre probabilidades condicionales
- Generatriz de Momentos
- Movimientos Brownianos y Procesos Wiener.
- Propiedades de los MB.
- Simulaciones

Sesión X

- Martingalas
- Filtraciones.
- Representación de martingalas.

Sesión XI

- Integral de ITO. Calculo de ITO.
- Diferencial Estocástica.
- Browniano Aritmetico.
- Browniano Geométrico.
- Puente Browniano.

Módulo II

Virtual en Vivo



INICIO

28

Sábado
Marzo

11 sesiones - 33 hrs

Sab. y Dom.
19:00 - 22:00
(hora de Perú)

COSTO

US\$ 330 + IGV

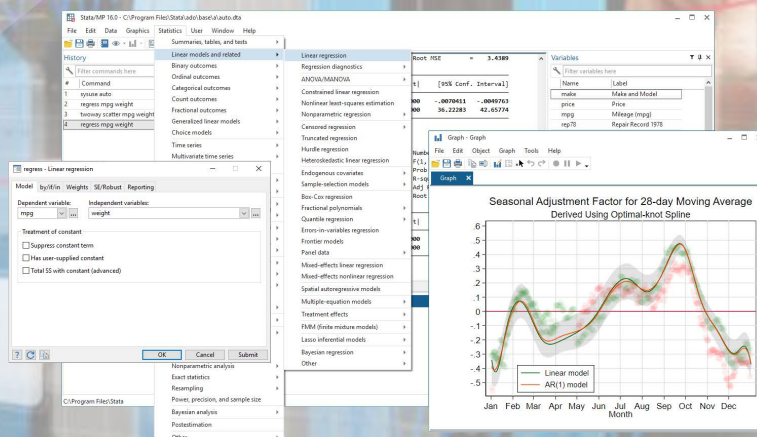
Curso 100% Práctico con STATA



Programa Modular en Econometría:

- **Módulo I: Econometría**
- **Módulo II: Series de Tiempo**
- **Módulo III: Microeconomía**

Evaluación supervisada en cada módulo



Plana Docente

- MSc(c). Economics, BSc. Economic Engineering, de la Ponticia Universidad Católica del Perú Ing. Economista de la Universidad Nacional de Ingeniería. Con experiencia en docencia en cursos de capacitación de Análisis Estadístico, Cuantitativo y Econométrico Aplicado para prestigiosas entidades.



Mayor Información

✉ info@quants-group.com

☎ +51 938 117 737

www.quants-group.com