

ECONOMETRÍA FINANCIERA CON STATA

Objetivo de Aprendizaje

- Reconoce la importancia del correcto análisis de datos suministrados para los análisis financieros de la información
- Conocer como modelar el riesgo financiero en las series de las distintas instituciones financieras o empresas de negocios corporativos.
- Conocer los fundamentos de los modelos econométricos financieros aplicados a resolver, identificar, modelar y predecir su comportamiento de manera científica.
- Utiliza los resultados obtenidos en la investigación ya sea con datos de los negocios, datos bursátiles o bancarios.

Sesión 01 Nociones de economía financiera, gestión de riesgo y teoría de carteras

- > El riesgo en los mercados financieros.
- > Introducción a la teoría de carteras.
- > Naturaleza de la econometría financiera.
- > Relaciones estructurales e identificación de variables.
- > El método de mínimos cuadrados ordinarios.
- > Características estadísticas de los coeficientes de regresión.
- > Inferencia sobre los parámetros del modelo.

Sesión 02 Stata para econometría financiera interfaz

- > Objetos y modificación de variables
- > Preparación de los datos y análisis estadísticos exploratorios
- > Estimación de parámetros de regresión
- > Test de Wald
- > Nociones de programación
- > Modelo de regresión lineal Simple

Sesión 03 No cumplimiento de los supuestos de regresión

- > Multicolinealidad
- > Autocorrelación
- > Heterocedasticidad
- > Estabilidad de los parámetros

Sesión 04 Retornos de activos financieros y series univariadas

- > Transformaciones estacionales
- > Características de las caminatas aleatorias
- > Pruebas de raíces unitarias: Dickey-Fuller
- > Tendencias determinísticas y ajustes estacionales
Hodrick-Prescott filtros
- > Aplicaciones en Stata

INFORMES E INSCRIPCIONES

- ☎ T.: (01) 712-7272
- ✉ extension@ue.edu.pe
- 🌐 <https://www.ue.edu.pe/programa-de-extension-universitaria-cursos-y-talleres>
- 📍 UNIVERSIDAD ESAN | Av. Alonso de Molina 1652, Surco, Lima - Perú

ECONOMETRÍA FINANCIERA CON STATA

Sesión 05

Modelos de series estacionarias

- > Estimaciones de procesos AR, MA y ARMA
- > Retornos de activos financieros
- > El problema de la Estacionalidad
- > Test de Box, QQ-plot, correlograma
- > Aplicaciones en Stata

Sesión 07

Modelos multivariados de series de tiempo

- > Estacionariedad multivariada
- > Vectores Autorregresivos (VAR)
- > Estimación, rezagos y diagnóstico
- > Funciones de impulso y respuesta y Descomposición histórica de la varianza
- > Causalidad de Granger
- > Cointegración: Engle-Granger, Johansen
- > Aplicaciones en Stata

Sesión 09

Examen Final

Sesión 06

Modelos de volatilidad condicional autorregresiva

- > El riesgo en mercados financieros: varianza incondicional
- > Modelos estacionarios de heterocedasticidad condicional
- > Ventanas de volatilidad, EWMA, GARCH
- > Pronóstico de volatilidad
- > Correlaciones condicionales
- > Modelos con autocorrelación en media: ARMA-GARCH
- > GARCH asimétrico: GJR-GARCH
- > GARCH
- > Nociones de transferencias en volatilidad
- > Aplicaciones en Stata

Sesión 08

Modelos factoriales y gestión de cartera

- > Modelos factoriales y riesgo Beta
- > Momentos de una cartera y rendimiento histórico
- > Gestión de carteras: enfoque media varianza (Markowitz y Sharpe).
- > Conjunto de oportunidades de inversión
- > Riesgo beta como medida de riesgo sistemático
- > Modelos factoriales y búsqueda estadística de factores.
- > Validación del CAPM
- > Aplicaciones en Stata

INFORMES E INSCRIPCIONES

T.: (01) 712-7272

✉ extension@ue.edu.pe

🌐 <https://www.ue.edu.pe/programa-de-extension-universitaria-cursos-y-talleres>

📍 UNIVERSIDAD ESAN | Av. Alonso de Molina 1652, Surco, Lima - Perú