

ECONOMETRÍA FINANCIERA CON STATA

Objetivo de Aprendizaje

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

Sesión 01 Regresiones lineales y estimación OLS

- > Introducción a la Econometría: métodos y tipo de información
- > Correlación vs causalidad (à la Granger)
- > El modelo de regresión múltiple
- > Estimación por el método de Mínimos Cuadrados Ordinarios (OLS)
- > Estimación e interpretación de los estimadores mínimo-cuadráticos
- > Aplicaciones en Stata

Sesión 02 Manipulación de datos en Stata

- > Importación, creación y guardado de base de datos
- > Directorio y archivos, y seteo de memoria
- > Creación de archivo Log y elaboración de archivo do file
- > Recodificación de variables
- > Análisis univariado y bivariado
- > Gráficos: histogramas, caja y bigotes, tallo y hoja, barras y pie
- > Modelo de regresión lineal simple

Sesión 03 Inferencia estadística con OLS

- > Distribución T-Student, Chi-Cuadrado y F
- > Distribución muestral de los estimadores OLS
- > Pruebas de hipótesis individual y global
- > Construcción de intervalos de confianza
- > Aplicaciones en Stata

Sesión 04 Violación de supuestos del modelo de regresión I

- > Manipulación de variables cualitativas
- > El fenómeno de la multicolinealidad: detección, corrección y alternativas de solución
- > Test de Farrar-Glauber y regresiones de Klein
- > Aplicaciones y programación 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

Violación de supuestos del modelo de regresión II

- > Heterocedasticidad: detección, corrección y alternativas de solución
- > Pruebas de Breusch-Pagan y White
- > Derivación de la fórmula de la varianza robusta a heterocedasticidad de White
- > Aplicaciones y programación en Stata

Sesión 07

No estacionariedad en media y raíces unitarias

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

Sesión 09

Examen Final

Sesión 06

Modelos de series estacionarias en media

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

Sesión 08

Modelos de volatilidad condicional autorregresiva

- > El riesgo en mercados financieros: varianza incondicional
- > Modelos estacionarios de heterocedasticidad condicional
- > Pronóstico de volatilidad
- > Correlaciones condicionales
- > Modelos con autocorrelación en media: ARMA - GARCH
- > GARCH asimétrico: TARARCH
- > 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