

Nuevo, por primera vez en Costa Rica

SEMINARIO TALLER INTERNACIONAL MODELACION ECONOMETRICA AVANZADA

Me dirijo a ustedes para invitarles por primera vez en Costa Rica a éste nuevo y actualizado Seminario - Taller, del cual seguidamente se incluye toda la información:

Fecha y Horarios: Lunes 20, Martes 21 y Miércoles 22 de Octubre 2008.

Duración: 24 horas en total. 3 días. 8am a 5pm.

Inversión: US\$ 750 por persona.

Lugar: Hotel Barceló San José Palacio.

Incluye: El material didáctico, certificado de participación y "Coffee breaks, almuerzos.

Forma de Pago: Cheque o transferencia a la cuenta corriente del Banco de Costa Rica N° 00102372479 nombre de Velchaz Investments Inc.

Asimismo, no omito manifestarle que la capacitación tendrá un enfoque inminentemente práctico, 80% y 20% teórico, por lo que se recomienda utilizar una Note Book o Portátil, al menos una por cada dos participantes.

Finalmente, les indicamos que el cupo es limitado por lo que agradecemos su pronta confirmación en dicha capacitación.

Cordialmente;

Ricardo Monteverde B.
Gerente de Mercadeo y Servicios
rmonteverde@rficonsultores.com

Anexo: Descripción y Programa

Especialistas en Riesgo, Finanzas e Inversiones.

OBJETIVO DEL PROGRAMA:

Este curso se focaliza en la especificación y estimación de modelos de regresión lineal. Se incluyen además tópicos como mínimos cuadrados generalizados, variables instrumentales, regresión no lineal y modelos de variables dependientes cualitativas. Además el curso considera modelos de series de tiempo de media y varianza univariados y multivariados, de manera de ir entregando las herramientas y fundamentos teóricos profundos para desarrollar aplicaciones empíricas de calidad. Aplicaciones al campo de las finanzas y economía se discuten a lo largo del curso. Programación en algún lenguaje (GAUSS o Matlab) se recomienda además de la utilización de software como EViews.

El desarrollo del curso consiste metodológicamente en dos partes:

- Desarrollo teórico de los modelos, y
- Aplicación a estimaciones con data real o simulada.

Duración del programa en horas:

Programa Curricular: 3 X 8= 24 horas
Duración total en días: 3 días

DESCRIPCION MODULAR

TEMARIO

1. Regresión Múltiple y Testeo de Hipótesis
 - 1.1. Representación Matricial y MCO
 - 1.2. Test de Restricciones
 - 1.3. Tests de Autocorrelación, Heteroscedasticidad y Colinealidad
 - 1.4. Estimación por MCG
 - 1.5. Tests de Estabilidad
 2. Modelos de Series de Tiempo Univariados
 - 2.1. AR(p), MA(q), ARMA(p,q), Procesos Integrados I(d), y Modelos ARIMA(p,d,q)
 - 2.2. Raíces Unitarias
 - 2.3. Modelos TAR y STAR
 3. Modelos de Vectores Autorregresivos VAR
 - 3.1. Especificación Algebraica
 - 3.2. Estimación
 - 3.3. Proyección e Intervalos de Confianza
 - 3.4. Determinación del Orden del VAR: Tests de Causalidad
 - 3.5. Criterios de AIC, HQ, y BIC de Determinación del Rezago Optimo
 - 3.6. Simulaciones de Política y Shocks: Funciones Impulso-Respuesta
 - 3.7. Cointegración y Modelos de Corrección de Errore
-

-
4. Modelos de Volatilidad y Asimetría
 - 4.1. Estimación por MV
 - 4.2. GARCH, TGARCH, EGARCH, GJRGARCH y QGARCH
 - 4.3. Curva de Impacto de Noticias (NIC)
 - 4.4. Modelos VGARCH
 - 4.5. Modelos Switching Markov

 5. Modelos No lineales, Algoritmos Genéticos y Redes Neuronales
 - 5.1. Estimación de Estructura de Tasas y Nelson-Siegel-Svensson NSS
 - 5.2. Regresión Kernel Cuadrático y Gaussiano
 - 5.3. Redes Neuronales
 - 5.4. Algoritmos Genéticos y Optimización

 6. Modelos con Variables Cualitativas y Truncadas
 - 6.1. Estimación Logit y Probit
 - 6.2. Modelos Multilogit
 - 6.3. Modelos Tobit

 7. Estimadores Extremos y Teoría Asintótica
 - 7.1. Criterios de Convergencia y LGN
 - 7.2. Propiedades asintóticas de estimadores OLS
 - 7.3. GMM y Modelos de Descuento Estocástico
 - 7.4. ML y LS revisitada

 8. Estimación por GMM y Modelos de Descuento Estocástico
-

* Este curso requiere que la audiencia disponga de un computador

EXPOSITOR:

Ingeniero Comercial, Mención Economía, Universidad de Chile e Ingeniero Comercial, Mención Administración Universidad de Chile. Master of Arts in Economics, ILADES/Georgetown University, Master of Arts in Economics, Duke University, Ph.D. Economics, Duke University. CPCL, Harvard. Especialista en Finanzas, Economía Aplicada a las Finanzas, Macroeconomía, Economía Monetaria y Modelos RBC. Profesor de Postgrado en Econometría Aplicada a las Finanzas, Econometría Lineal, Finanzas Corporativas, Estrategia de Inversiones, Macroeconomía y Política Económica.

Head of the International Money Desk del Banco Central de Chile, a cargo de la administración de las reservas internacionales (inversiones en sovereigns Bonds, supranationals, short term papers, y riesgo bancario). Economista senior del Banco Central de Chile, participando activamente en la organización de seminarios y conferencias internacionales. Consultor de empresas públicas y privadas del sector financiero y del sector real. Profesor visitante Universidad Jonkoping, Suecia, y universidades en diversos países como Ecuador, República Dominicana, México, Paraguay, así como consultor internacional del BID, Banco Mundial, y diversos bancos centrales latinoamericanos. Posee numerosas publicaciones en revistas especializadas. Miembro del Comité Editorial de la revista Estudios de Administración y referee de numerosas revistas especializadas en finanzas y economía. Consultor permanente de la prensa escrita así como de canales de televisión y radioemisoras de Chile en temas financieros y económicos.

Actualmente es Director del Master of Science en Finanzas y Profesor Titular, Escuela de Negocios, Universidad Adolfo Ibáñez Chile.

±

Aparte hoy mismo su espacio. Cupo limitado

Información e inscripciones

info@rficonsultores.com

capacitación@rficonsultores.com

Conozca nuestros servicios, visítenos en

www.rficonsultores.com

Especialistas en Riesgo, Finanzas e Inversiones.