



DIVISIÓN:	CIENCIAS ECONÓMICAS Y ADMINISTRATIVAS
FACULTAD	ADMINISTRACIÓN DE EMPRESAS
PROGRAMA ACADÉMICO:	ESPECIALIZACIÓN EN FINANZAS
DENOMINACIÓN DEL ESPACIO	ECONOMETRÍA FINANCIERA
METODOLOGÍA	Presencial
NATURALEZA DEL ESPACIO	Teórico-práctico
NÚMERO DE CRÉDITOS ACADÉMICOS	Dos (2)

OBJETIVO/PROPÓSITO

Aplicar conceptos y métodos de la econometría para la toma de decisiones en el campo de la gerencia financiera.

ELEMENTOS BÁSICOS DE ECONOMETRÍA

- Conceptos de estadística descriptiva: media, varianza, desviación estándar y distribución normal.
- Estadística inferencial: Pruebas de hipótesis, probabilidad.
- Concepto, utilidad y metodología de la econometría.
- Variables y modelos en econometría.
- Modelo de regresión lineal simple y múltiple
- Violación a los supuestos básicos del modelo lineal

ANÁLISIS ECONOMÉTRICO

- Interpretación de resultados en un modelo econométrico
- Pruebas de robustez en un modelo econométrico
- Introducción a las series de tiempo
- Aplicaciones financieras

MODELOS DINÁMICOS

- Tendencias, regresiones espurias y transformaciones hacia la estacionariedad.
- Auto-correlación y series de tiempo: modelos autoregresivos, ARIMA
- Cointegración y el modelo de corrección de errores
- Aplicaciones financieras