

AGENDA

Curso de estadísticas y econometría aplicada al comercio

Instructores:

- José Durán Lima, CEPAL, División de Comercio Internacional e Integración.
- Sebastián Castresana, CEPAL, División de Comercio Internacional e Integración.
- Claudio Aravena, CEPAL, División de Desarrollo Económico.

Este taller fue organizado por la División de Comercio Internacional e Integración de la CEPAL con la colaboración de la ALADI, el Ministerio de Hacienda del Paraguay y AECID. Se realizó entre el 25 y el 28 de septiembre de 2012 en Asunción, Paraguay. Los instructores fueron: José Durán Lima , Sebastián Castresana, de la División de Comercio Internacional e Integración y Claudio Aravena de la División de Desarrollo Económico. El objetivo del curso fue presentar modelos de proyección de comercio internacional adaptados a la economía del Paraguay utilizando herramientas econométricas y estadísticas aplicadas a programas computacionales (Eviews).

DÍA 1 – Martes 25 de septiembre de 2012

08:30 Presentación del Taller e introducción al material bibliográfico y el CD.

09:15 Modulo 1: Generalidades estadísticas

- Población vs. muestra
- Indicadores de tendencia central
- La distribución normal y otras
- Disposición de los datos: “cross-section”, “time series” , “Panel data”

10:30 Modulo 2: El tratamiento de los Datos

- Fuentes
- Transformaciones
- Tasas de crecimiento
- Números índice
- Desestacionalización
- Organización de una base de datos para Eviews y/o Stata

13:30 Modulo 3: Introducción al Eviews

- Ambientación general del Programa
- Preparación de un archivo de trabajo
- Operadores matemáticos
- Edición de los datos según tipo de serie
- Transformación de series, números índices e interpolación
- Gráficos de series (X en Y, barras, dispersión, columnas)
- Estadígrafos básicos con Eviews (Histograma y estadísticos básicos)

15:30 Modulo 4: Ejercicios prácticos con Eviews. Ejercicio guiado.

17:00 – Cierre

DÍA 2 – Miércoles 26 de septiembre de 2012

08:30 Modulo 5: El Modelo Lineal Básico (OLS). Teoría

- Modelo básico de regresión
- Lógica del modelo de regresión
- Supuestos de los estimadores
- Principales tests
- Interpretación

10:30 Modulo 6: El Modelo Lineal Básico (OLS). Aplicación

- Cautelas (causalidad/correlación, etc.)
- Propiedad de los estimadores
- Regresiones simples
- Regresiones de múltiples variables
- Variables mudas (Dummies) y controles
- Interpretación de los resultados

13:30 Módulo 7: Ejercicio Práctico Modelo OLS en Eviews

- Principales test en Eviews
- Heterocedasticidad
- Autocorrelación
- Corriendo una regresión
- Análisis de errores
- Interpretando los resultados

15:30 Módulo 8: Series de tiempo

- Series de tiempo
- Componentes de series de tiempo
- Desestacionalización
- Desestacionalizando con X12

17:00 Cierre

DÍA 3: Jueves 26 de septiembre de 2012

08:30 Modulo 9

- Características principales de las series de tiempo
- Correlogramas y Autocorrelogramas

- Familias de modelos: AR, MA, ARMA, ARIMA, SARIMA

10:30 Modulo 10 Series de tiempo. Aplicación

- Ejercicio práctico de estimación con modelos ARIMA
- Estudio de correlogramas
- Estudio de estacionariedad

13:30 Modulo 11: Modelos Alternativos (Ejercicio Eviews)

- Modelos Multivariados. VAR/VEC
- Modelos Log-Lin
- Modelos Cointegración Engel-Granger

15:30 Modulo 12 Proyección de comercio con Eviews

- Desestacionalización de las series
- Definición del modelo
- Revisión de autocorrelogramas
- Decisión de rezagos
- Estimación del modelo
- Proyección del comercio (Forecast)

17:00 - Cierre

DÍA 4: Viernes 27 de septiembre de 2012

08:30 Módulo 13: Datos de Panel. Teoría

- Características principales del análisis de Panel
- Efecto Fijo
- Efecto Aleatorio
- Variables de instrumento

10:30 Módulo 14: El modelo de gravedad

- Características principales del modelo de gravedad
- Variables explicativas usuales
- Definiendo una base de datos para la economía del Paraguay
- Caso práctico tipo

13:30 Módulo 15: Taller Integrador

- Introducción a la dinámica del taller
- Comienzo de actividades.

15:30 Módulo 16: Taller Integrador

- Finalización del taller
- Evaluación del curso.

16:30 - Cierre y entrega de Diplomas.