

# **CURSO:** **MACROECONOMETRÍA APLICADA**

**Intermedio - Avanzado**

*“Estudia con expertos en Economía,  
Finanzas y Econometría Aplicada”.*

*Docentes con estudios de posgrado en el extranjero y con más de 10  
años de experiencia profesional.*



# Módulo I - Intermedio

## **REGRESIONES CON SERIES DE TIEMPO / DESESTACIONALIZACIÓN CON TRAMO SEATS (PROYECCIONES Y ANÁLISIS MACROECONÓMICO)**

*Aplicaciones con E-views y Tramo Seats*

*Profesor: Mg. William Sánchez - University of Sussex, UK*

*Profesor: Mg. Ismael Mendoza – Universidad del pacífico*

## **MÉTODO GENERALIZADO DE MOMENTOS – GMM (ESTIMACIÓN DEL IMPACTO DE LOS CHOQUES EXTERNOS SOBRE EL PBI)**

*Aplicaciones con Eviews*

*Profesor: Mg. José Luis Nolasco – Universidad de Chile*

## **DESCOMPOSICIÓN DE UNA SERIE DE TIEMPO (ESTIMACIÓN DEL PBI POTENCIAL: MÉTODO FUNCIÓN DE PRODUCCIÓN)**

*Aplicaciones con E-views, Rats, Jmulti y Oxmetrics*

*Profesor: Mg. William Sánchez – University of Sussex, UK.*

## **MODELOS VAR, VARX Y SVAR (PROYECCIONES, ANÁLISIS MACROECONÓMICO Y SIMULACIONES DE ESCENARIOS)**

*Aplicaciones con E-views y Jmulti*

*Profesor: Mg. William Sánchez – University of Sussex, UK.*

## **MODELOS DE VOLATILIDAD (ARCH, GARCH, TARCH Y EGARCH)**

*Profesor: Ing. Economista Richard Pérez – Universidad Nacional de Ingeniería.*

## **MODELOS DE COINTEGRACIÓN (ENGLE-GRANGER, PHILLIPS-OLUARIIS Y JOHANSEN)**

*Aplicaciones con E-views y Jmulti.*

*Profesor: Mg. William Sánchez – University of Sussex, UK.*



# Módulo II - Avanzado

**MODELOS DE ESTADO ESPACIO Y FILTRO DE KALMAN (ESTIMACIÓN DEL CICLO COMÚN DE LOS PAÍSES DE LA ALIANZA DEL PACÍFICO)**

*Aplicaciones con E-views.*

*Profesor: Mg. William Sánchez - University of Sussex, UK.*

**MODELOS VAR CON PARÁMETROS CAMBIANTES EN EL TIEMPO CON VOLATILIDAD ESTOCÁSTICA - TVP-VAR-SV- (IMPACTO DE LA TASA DE MOROSIDAD EN EL MERCADO FINANCIERO)**

*Aplicaciones con Matlab, E-views*

*Profesor: Mg. Juan Tenorio – Georgetown University*

**MODELOS NO LINEALES CON CAMBIO DE RÉGIMEN: TAR, STAR, SETAR, MSVAR (ESTIMACIÓN DE LOS EFECTOS DE LOS SALARIOS MÍNIMOS EN EL EMPLEO Y LA INFORMALIDAD; EFECTOS MACROECONÓMICOS NO LINEALES DE LA POLÍTICA FISCAL EN EL PERÚ)**

*Aplicaciones con E-views, Matlab y R*

*Profesor: Mg. Juan Tenorio – Georgetown University*

**MODELOS DATOS DE PANEL PARA ESTIMAR LOS DETERMINANTES DEL CRECIMIENTO ECONÓMICO**

*Aplicaciones con Stata 16*

*Profesor: Mg. William Sánchez - University of Sussex, UK.*

**VARIABLES INSTRUMENTALES Y MODELOS DE ELECCIÓN DISCRETA APLICADA AL CRECIMIENTO ECONÓMICO (ESTIMACIÓN DEL IMPACTO DE LAS INSTITUCIONES EN EL CRECIMIENTO ECONÓMICO)**

*Aplicaciones con Stata 16*

*Profesor: Mg. William Sánchez - University of Sussex, UK.*

