

PLANA DOCENTE

JUAN CARLOS ABANTO ORIHUELA

MSc(c). Economics, BSc. Economic Engineering, de la Pontificia Universidad Católica del Perú Ing. Economista de la Universidad Nacional de Ingeniería. Con experiencia en docencia en cursos de capacitación de Análisis Estadístico, Cuantitativo y Econométrico Aplicado para prestigiosas entidades como MINDES, MINTRA, SEUPROS-UNI entre otras. Ha realizado diversos trabajos de investigación relacionados a economía, finanzas y comercio exterior. Ha desempeñado el cargo de Analista Cuantitativo en el MEF, Analista Comercial en ENAPU, Asesor en proyectos de investigación en FONDEPES, OSINERGMIN, GOVERNA. Actualmente es docente UNI - FIEECS.

GERSON E. BRAVO CASTRO

MSc. Economics, BSc. Economic Engineering, candidate FRM Level II. Profesional de Ingeniería económica de la UNI, con estudios en Gestión de Riesgo de Crédito (ALIDE). Con experiencia en docencia en cursos de capacitación de Análisis Estadístico y Software Econométrico Aplicado para prestigiosas entidades como BCRP, MINTRA, COFIDE, SEUPROS-UNI entre otras. Con experiencia en elaboración de estudios de investigación relacionados a econometría financiera y cuantificación del riesgo de crédito. Actualmente, se desempeña como Analista de Gestión de Riesgo de Crédito en la Corporación Financiera de Desarrollo - COFIDE y ha laborado anteriormente en el Área de Inteligencia de Negocios del BCP. Actualmente es docente UNI - FIEECS.

RAFAEL CAPARÓ CORONADO

PhD(c). Quantitative Finance, MSc Applied Statistic, MSc Applied Bank and Finance Econometric, BSc. Economic Engineering (Francia). Se ha destacado en temas de gestión cuantitativa de riesgos financieros. A nivel profesional se ha desarrollado en instituciones financieras nacionales (Bco. de Comercio, Pacifico Peruano Suiza) e internacionales (Groupe Risque du Portafuille del BN, Natixs, Amund), implementando modelos cuantitativos para el Backtesting, y dispositivos de stress testing en software tipo R y MATLAB. Áreas de Interés: Macroeconometría y Econometría Financiera. Actualmente es docente UNI- FIEECS

WILLIAM RICHARD SÁNCHEZ TÁPIA

Mag. En Economía en la Universidad del Pacífico, sustentación de tesis de maestría con calificación sobresaliente "cum laude", con el trabajo de investigación: "Fluctuaciones Económicas y Rigideces Financieras": Un modelo de Equilibrio General con Intermediarios Financieros. Ha cursado el 55 Curso de Extensión Universitaria del Banco Central de Reserva del Perú (BCRP) en el campo de teoría económica (2008). Se graduó en el primer puesto de su promoción en la carrera de economía en la Universidad Nacional Mayor de San Marcos. Especialista en Macroeconomía y Herramientas Cuantitativas.

SISTEMA DE EVALUACIÓN

La evaluación general del programa de especialización es la siguiente:

La Aprobación por módulo se divide en:

Asistencia total al módulo **(20%)**

Promedio de notas del módulo **(80%)**

Aprobación del programa

Asistencia total del programa de especialización **(20%)**

Promedio de notas de los Módulos **(80%)**

La Nota aprobatoria es de **13.0**

HORARIO

Sábados de 03:00pm a 08:00pm

domingos de 09:00am a 01:00pm

CERTIFICACIÓN

Se otorgará **DIPLOMA DE ESPECIALIZACIÓN** a nombre de la **FIEECS** de la **UNI**.

INVERSIÓN

Al Contado S/.4,000.00

Deposito BANCO SCOTIABANK

Financiado en 04 cuotas S/.4,400.00

CONCEPTO 366 (Cursos, Fórum, Seminarios FIEECS)

SE ACEPTAN PAGOS CON TARJETAS DE CRÉDITO

1° cuota S/.1,100.00

2° cuota S/.1,100.00

3° cuota S/.1,100.00

4° cuota S/.1,100.00



INFORMES E INSCRIPCIONES

Facultad de Ingeniería Económica, Estadística y Ciencias Sociales (FIEECS)

Av. Túpac Amaru N° 210 – Rímac, Pabellón M, 2do. Piso

Directo: 382-4708 Teléfono: 481-1070 anexo 339

E-mail: seupros@fieecs.org ; seupros@gmail.com

Página web: www.fieecs.org

HORARIO DE ATENCIÓN

De lunes a viernes

Mañana: 9 a.m. - 1 p.m. Tarde: 2 p.m. - 5 p.m.

sábados de 10:00 a 18.00 p.m



PROGRAMA DE ESPECIALIZACIÓN EN ECONOMETRÍA APLICADA



UNIVERSIDAD NACIONAL
DE INGENIERÍA

FACULTAD DE INGENIERÍA ECONÓMICA, ESTADÍSTICA
Y CIENCIAS SOCIALES

SECCIÓN DE EXTENSIÓN UNIVERSITARIA Y PROYECCIÓN SOCIAL - SEUPROS

PRESENTACIÓN

Tomando en consideración la demanda de profesionales en el campo del análisis cuantitativo por parte del sector público y privado, la FIEECS ha diseñado el Programa de Especialización en Econometría Aplicada (PEEA) de tal manera que sirva como base para futuras especializaciones en los campos del desarrollo social, las finanzas y otros campos donde el manejo de los datos permita medir políticas, monitorear resultados y validar conclusiones a nivel general tanto de políticas públicas y del políticas dentro del sector financiero . El PEEA es un programa revolucionario porque permite incursionar en diferentes ciencias y así profundizar en temas importantes donde la econometría se hace necesaria, como son, por ejemplo la econometría de la evaluación de impactos, la econometría para la evaluación económica y la econometría bancaria y financiera. Es importante resaltar que el programa da al participante la oportunidad de desarrollar un proyecto de investigación con el soporte de un acompañamiento especializado.

OBJETIVOS

- Promover la evaluación del impacto de políticas públicas y privadas, así como el diagnóstico y evaluación de los diferentes sectores económicos (financiero, industria, minería, etc) a través de la aplicación práctica de las técnicas más avanzadas en el campo de la econometría moderna.
- Aportar elementos fundamentales a la toma de decisión de agentes encargados de llevar adelante programas económicos, de desarrollo o programas financieros en las diferentes empresas o instituciones públicas o privadas, así como programas de desarrollo en el sector público.
- Desarrollar las bases para la elaboración de documentos de investigación aplicados.

¿A QUIÉNES VA DIRIGIDO EL PROGRAMA?

Está dirigido a profesionales, tales como ingenieros economistas, economistas, científicos sociales, personas que laboran en instituciones financieras, interesados en la evaluación cuantitativa de políticas públicas así como el diagnóstico y tendencias del sector financiero e instituciones reguladoras.

METODOLOGÍA

El programa tiene un alto porcentaje dedicado a la investigación y al apoyo en el desarrollo de documentos de trabajo, tesis y otros tipos de sustentaciones científicas para optar por un grado académico. En tal sentido se le provee al participante un acompañamiento durante todo el programa para que pueda presentar un documento final de investigación utilizando los conocimientos impartidos durante el programa.

EL PEEA requiere de manejo de software especializado en diferentes campos de la econometría, es este sentido se ha programado sesiones de nivelación y adiestramiento en los software a través de aplicaciones consideradas dentro de las certificaciones internacionales más conocidas.

TEMARIO

Dividido en 4 módulos el temario del PEEA está diseñado para formar una base en econometría aplicada que pueda servir como inicio para otras especializaciones de la econometría, tales como econometría financiera, econometría para la evaluación de impactos de políticas públicas, desarrollo social, econometría aplicada para la evaluación económica

PEEA

- ✓ **MODULO I: Nivelación y manejo de software: "software skills"**
- ✓ **MODULO II: Aplicaciones Microeconómicas**
- ✓ **MODULO III: Aplicaciones Macroeconómicas**
- ✓ **MODULO IV: Datos de panel y Econometría de la evaluación de impactos**



MODULO I:

NIVELACIÓN Y MANEJO DE SOFTWARE: "SOFTWARE SKILLS"

Validación y nivelación de conocimientos de software econométricos ("software skills") (9 horas)
Validación de conocimientos del manejo del software R, EViews, MATLAB, Stata y Rats. Nivelación de conocimientos en el manejo de los editores(r,prg,m,do), manejo ventanas , exportación de resultados, importación de inputs.

Econometría Intermedia (18 Horas)
Nivelación en los siguientes temas: Mínimos Cuadrados Ordinarios. Evaluación de modelos. Evaluación de hipótesis. Problemas clásicos en estimaciones. Solución a problemas de varianza. Propiedades en muestras grandes.

MODULO II:

APLICACIONES MICROECONÓMICAS (36 HORAS)

Microeconometría aplicada I (18 horas)
Estimación por máxima verosimilitud. Modelos de respuesta binaria y múltiple. Modelos con regresores endógenos. Sistemas de ecuaciones con regresores exógenos y endógenos.

Microeconometría aplicada II (18 Horas)
Modelos de respuesta ordenada. Modelos de conteo. Modelos de panel jerárquicos y multinivel. Modelo de sesgo de selección. Modelos censurados y truncados. Fronteras estocásticas. Modelos de duración.

MODULO III:

APLICACIONES MACROECONÓMICAS (36 HORAS)

Macroeconometría aplicada I (18 horas)
Procesos estocásticos, raíces unitarias. ARMA, ARIMAX, SARIMAX, ARFIMA. Filtros. Cointegración uniecuacional. Modelos VAR. Modelos SVAR. Modelos VEC

Macroeconometría aplicada II (18 horas)
Modelos umbral. Modelo espacio estado. Frecuencia espectral. Econometría bayesiana. Evaluación de escenarios.

MODULO IV:

DATOS DE PANEL Y ECONOMETRÍA DE LA EVALUACIÓN DE IMPACTOS (36 HORAS)

Datos de panel (18 horas)
Aplicaciones a datos de panel I
Panel Básico. Modelo con coeficientes aleatorios. Respuesta binaria. Regresores endógenos.
Aplicaciones a datos de panel II
Datos de panel dinámicos. Modelos de datos de conteo. GLM y Modelos Censurados.

Econometría de la Evaluación de impactos (18 horas)
Average Treatment Effects. Matching: método de vecino más cercano, estratificación, kernel, Radius y Leuven. Propensity Score Matching. Algoritmos, sensibilidad de resultados. Evaluación de Tratamientos múltiples y efectos indirectos de los programas.