



MÉTODOS CUANTITATIVOS PARA INVERSIÓN

Objetivo

Al final del curso, el alumno habrá adquirido y desarrollado habilidades cuantitativas, estadísticas y analíticas para examinar la relación entre dos o más variables financieras. También habrá mejorado su capacidad para la identificación y planteamiento de problemas, elección y construcción de modelos y su uso en la toma de decisiones de inversión.

Contenido

1. Pruebas de hipótesis
Errores tipo I y II; Pruebas de Hipótesis respecto a la media; Pruebas de Hipótesis respecto a la varianza; Inferencia no paramétrica.
De Fusco, et al. Cap. 7
1. Correlación y regresión
Análisis de correlación; regresión lineal simple; modelo MCO; modelo CAPM
De Fusco, et al. Cap. 8
2. Regresión múltiple
Supuestos; R^2 ajustada; violaciones de los supuestos; especificación del modelo y errores de la especificación; variables dummy; variables dependientes cualitativas; tópicos del modelo múltiple: heterocedasticidad; autocorrelación; multicolinealidad; estimador mínimo cuadrado generalizado
De Fusco, et al. Cap. 9
3. Análisis de series de tiempo
Modelos de tendencia; modelos autorregresivos (AR); caminata aleatoria; pruebas de raíz unitaria; modelos de promedios móviles; estacionariedad; heterocedasticidad condicional; pronósticos
De Fusco, et al. Cap. 10

Bibliografía

- (DeFusco et al) DeFusco, R. A., McLeavey, D. W., Pinto, J. E., & Runkle, D. E. (2004).CFA *Quantitative Methods for Investment Analysis* (2a. ed.). Baltimore: CFA Institute. Program curriculum (2020). Quantitative methods

