

HERRAMIENTAS PARA EL ANÁLISIS DE SERIES DE TIEMPO EN R



Oficina de la CEPAL en Buenos Aires. Modalidad virtual.



Presentación

Este taller tiene como objetivo introducir a los participantes en las principales funciones del software R para trabajar con series de tiempo y aplicarlas al análisis macroeconómico. La modalidad de trabajo será teórico-práctica, con un módulo de repaso conceptual y otro de implementación en el código de programación. Se dará énfasis en aplicaciones con datos de comercio exterior, precios y actividad de Argentina.

Requisito: Se sugiere contar con conocimientos previos de estadística.

Fecha y horario: El curso se dictará los jueves de 9.30 a 12.30hs, entre el 7 y el 28 de octubre (inclusive).

Contenidos

Clase 1. Introducción a series de tiempo en R. Presentación de la colección de librerías de Tidyverse y revisión de un conjunto de operaciones para la transformación de datos.

Clase 2. Modelo de regresión lineal y métricas para la selección de variables. Estimación de modelos por el método de mínimos cuadrados ordinarios y selección de variables según aquellos modelos que ajusten mejor a la muestra de datos.

Clase 3. Cointegración y modelo de corrección de errores. Pruebas de raíz unitaria y de cointegración, y estimación de un modelo de corrección de errores.

Clase 4. Modelos VAR y métricas para la evaluación de proyecciones. Estimación de modelos VAR y métricas para evaluar la precisión de los modelos según su error de pronóstico.