

SEMINARIO-TALLER DE ECONOMETRÍA FINANCIERA

Contacto: David Trillo (+34 607753543) vilaconsultores@telefonica.net

1. Modelo lineal general. Principales resultados y estadísticos. Estimación de betas. Interpretación de los resultados de la estimación. Correlación y causalidad. Regresiones espurias. Análisis de los residuos. Estimación de relaciones entre tasas de interés. Estimación de relaciones entre tipos de cambio. Errores de especificación. Autocorrelación. Heterocedasticidad.

2. Modelos ARIMA. Procesos estacionarios. Ejemplos. Paseo aleatorio. Ruido blanco. Función de autocorrelación. Función de autocorrelación parcial. Modelos autorregresivos. Modelos media móvil. Modelos estacionales. Modelos de función de transferencia. Datos atípicos. Análisis de intervención. Raíces unitarias. Tests de raíces unitarias. Cointegración. Modelos de corrección de error. Tests de cointegración.

3. Predicción. Modelos de predicción. Error de predicción. Inflación. Índice de precios del productor. Producción industrial. PIB. Comercio exterior. Agregados monetarios. Tasas de interés. Tipos de de cambio. Alcance de los modelos de predicción. Modelos vectoriales autorregresivos (VAR). Función de respuesta al impulso.

4. Volatilidades. Modelos GARCH. Modelos EGARCH. Aplicación a la estimación de riesgos de mercado. Matrices de varianzas covarianzas. Modelos GARCH multivariantes. Volatilidad tipo de cambio COP/USD. Volatilidad TES. Volatilidad índice Bolsa. Volatilidad primas de riesgo de deuda soberana.

5. Modelos de variable dependiente cualitativa. Modelo lineal de probabilidad. Modelos logit y probit. Análisis discriminante. Problemas de las muestras. Interpretación de los resultados. Riesgo de crédito. Probabilidad de default. Modelos basados en la teoría de opciones.