

Webcast

Cálculo de la Volatilidad del Precio de Acciones Usando Modelos GARCH en EViews 8

Descripción

Este webcast comienza con una introducción a la literatura de los modelos de volatilidad que varían en el tiempo y aborda, de manera sucinta, la implementación de la clase de modelos ARCH/ GARCH/EGARCH. Asimismo, se presenta una aplicación en EViews 8 usando la serie de retornos del Índice de Retornos de la Bolsa de Valores de Lima (IBVL) y, finalmente, se compararán diferentes especificaciones de la clase de modelos GARCH/EGARCH.

Dirigido a

Directores, profesionales, analistas, docentes e investigadores que en sus labores requieran de la utilización de métodos estadísticos y econométricos.

Objetivo

El objetivo primordial es presentar al participante las diferentes aproximaciones tanto teóricas como prácticas para el tratamiento de series de tiempo y de una manera muy simple realizar un análisis de manejo de datos, apoyados con EViews, una de las más poderosas herramientas de software para tal fin.

Temario

- Características de la volatilidad.
- Modelos de Volatilidad.
- Modelos ARCH / GARCH.
- Justificación de los modelos ARCH.
- Aplicación al índice general de la bolsa de valores de Lima.
- Posibles Variantes.
- Estimación de Modelos ARCH(1) y GARCH(1,1).
- Preliminares o Básicos.
- Centrados en el carácter asimétrico.
- Centrados en la permanencia en volatilidad.
- Resto de Modelos.

Instructores

Fernando Jáuregui Puertas

Acreditado con la Certificación Internacional en Administración de Riesgos CRM, impartida con el Dr. Jonathan Mun. Profesional en Ciencias Económicas de la Universidad Nacional de Ingeniería del Perú. Executive Master in Financial Analysis en la Universidad Carlos III de Madrid (España). Adicionalmente, cuenta con especialización en Gestión de Riesgos Financieros en BURSEN (Centro de Estudios Bursátiles de la Bolsa de Valores de Lima) y en Formulación y Evaluación de Proyectos de Inversión Pública en la Universidad ESAN. Actualmente es docente de la Maestría en Finanzas de la Universidad del Pacífico (Perú) e instructor de SOFTWARE shop para LATAM. Tiene experiencia en el sector público como Analista de

Proyectos de Inversión y en el Sector Bancario como Analista de Estudios Económicos. Anteriormente se desempeñó como docente de la Facultad de Ingeniería Económica de la Universidad Nacional de Ingeniería (Perú), en las asignaturas de Econometría II y Análisis de Series Temporales.

Información General

Duración

1 Hora

Fecha de Inicio

Jue. 04 de Sep de 2014

Horarios

San José de Costa Rica 10:00 a.m México D.F. 11:00 a.m Bogotá 11:00 a.m Quito 11:00 a.m Lima 11:00 a.m Caracas 11:30 a.m Bolivia 12:00 m Buenos Aires 1:00 p.m Santiago 12:00 m



Políticas

Para conocer en detalle las condiciones y políticas de participación en los eventos, ingrese a nuestro link <https://www.software-shop.com/formacion/politicas>

Inscríbete ahora