Webcast

Modelos que incorporan volatilidades: ARCH y GARCH

Descripción

Reconocer que en el estudio de series de tiempo nos enfrentamos a diferentes comportamientos de los datos es una necesidad que demanda diferentes alternativas estadísticas que permitan concluir de manera acertada, adicional a hacer inferencia estadística acorde a las particularidades que tiene cada grupo de datos. En "Modelos ARCH Y GARCH" realizaremos un repaso de conceptos de volatilidad en las series de tiempo, soportado en ejemplos prácticos y útiles en el estudio econométrico y financiero, que permitan fortalecer el entendimiento de series de tiempo y de modelación econométrica.

Dirigido a

Profesionales, investigadores, docentes, estudiantes y en general a todas las personas que estén interesadas en aprender o repasar elementos de identificación y modelación de series de tiempo cuya varianza no es condicionalmente constante (hetorecedasticidad).

Objetivo

- Identificar y reconocer la existencia de heterocedasticidad en las series de tiempo y su implicación en la toma de decisiones en el estudio estadístico.
- Entender los conceptos de especificación y modelación de series de tiempo heterocedásticas a través del análisis estadístico y gráfico.

Temario

- Volatilidad
- Modelo ARCH
- Especificación y estimación modelo ARCH
- Modelo GARCH
- Especificación y estimación modelo GARCH

Instructores

Cristian Camilo Rincón Romero

Economista de la Universidad Externado de Colombia. Monitor de Microeconomía para los estudiantes de Finanzas y participante del comité editorial de la revista de estudiantes de la Facultad de Economía, Divergencia. Formó parte del semillero de investigación de mercados y organización industrial donde ayudó en la investigación de caracterización del sector aeronáutico en Colombia y realizó su pasantía en el Ministerio de Hacienda y Crédito Público para la Dirección General de Participaciones Estatales.

Información General

Duración

1hora

Fecha de Inicio

Vie. 28 de Jul de 2017

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 p.m

Herramientas de apoyo

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