

Objetivo General:

Proporcionar al alumno las metodologías para la valuación de los derivados financieros y su empleo en la administración de riesgos financieros, destacando, en particular, la implementación y operación del Valor en Riesgo (VaR), así como sus capacidades y limitaciones como medida coherente de riesgo.

Contenido

1. Ortogonalidad y proceso de Gram- Schmidt
2. Mínimos Cuadrados Ordinarios
Funcionamiento y valuación de contratos adelantados
 - Supuestos y condiciones de MCO.
 - Interpretación de coeficientes y bondad de ajuste.
3. Propiedades de muestra finita
4. Propiedades asintóticas.
5. Prueba de hipótesis.
6. Variables Dummy.
7. Heteroscedasticidad.
8. Modelos de ecuaciones simultáneas.
9. Máxima Verosimilitud.
10. Modelos Logit, Probit y Tobit.

Bibliografía

Stanley, I. Grossman. (1966). Algebra Lineal. Editorial Mc Graw Hill.

Gujarati, Damodar N. (1997). Econometría. Tercera Edición. Mc Graw Hill.

Hayashi, F. (2000). Econometrics, Princeton University Press.

Poole, D. (2006). Linear Algebra: A. Modern Introduction. 2° Edition. Thomson Brooks/Cole.

Brockwell P.J. and Davis R.A. (2002). Introduction to Time Series and Forecasting. 2nd ed., Springer.

Campbell, J.Y., Lo, A.W., and Mackinlay, A.C. (1997) The Econometrics of Financial Markets. Princeton University Press.

Enders W. (2004). Applied Econometric Time Series. 2nd ed., Wiley.

Hamilton, J. (1994). Time Series Analysis. Princeton University Press. 1994

Hayashi, F. (2000). Econometrics. Princeton University Press. 2000

Mills T.C. (1999). The Econometric Modelling of Financial Time Series. 2nd ed., Cambridge University Press.

Stock W., James y Watson, Mark (2012). Introducción a la Econometría. Prentice Hall, 2012

Wooldridge, J.M. (2003). Introductory Econometrics: A Modern Approach,. 2nd ed., Thomson South-Western.

Lee C. Adkins and R. Carter Hill (2011). Using Stata for Principles of Econometrics. Fourth Edition, Stata Press, 2011.

Greene, William H. (2011). Econometric Analysis. Prentice Hall, 7th Edition.

Especialidad en Administración de Riesgos Financieros

Econometría

Verbeek, Marno (2012). A Guide to Modern Econometrics. John Wiley and Sons.

Martin, Vance, Stan Hurn y David Harris (2013). Econometric Modelling with Time Series: Specification, Estimation and Testing. Cambridge University Press.

Número de Créditos

- Tres

Horas de clase por semana

- Seis

Coordinador de Asignatura

Dr. Domingo Rodríguez Benavides

Instrumentos de Evaluación

- 2 exámenes parciales con un valor del 30% cada uno
- 1 examen final con un valor del 40%