



PROGRAMA DE CURSO DE POSGRADO

TÍTULO: Modelos dinámicos de activos financieros	
AÑO: 2013	CUATRIMESTRE: Primero
CARGA HORARIA: 60 horas	No. DE CRÉDITOS: tres
CARRERA/S: Doctorado en Matemática y Doctorado en Ciencias de la Computación	
DOCENTE ENCARGADO: Oscar Bustos	

PROGRAMA

UNIDAD 1: Especificación del modelo y estrategias de estimación

Distribuciones totalmente especificadas – Distribuciones con restricciones – Sin información previa acerca de las distribuciones – Estimadores de momentos generalizados (GMM-estimadores).

UNIDAD 2: Propiedades asintóticas de estimadores de extremos

Modelo de probabilidad básico – Condiciones generales para la consistencia – Consistencia de estimadores de extremos – Normalidad asintótica de estimadores de extremos – Distribuciones de estimadores de máxima verosimilitud, pseudomáxima verosimilitud y GMM – Eficiencia relativa.

UNIDAD 3: Tests de bondad de ajuste

Estimadores GMM – Tests de restricciones sobre parámetros – Comparaciones entre diversos tests de bondad de ajuste – Inferencia sobre estimadores secuenciales – Inferencia cuando se tienen muestras poblacionales con tamaños diferentes.

UNIDAD 4: Procesos afines

Conceptos básicos – Procesos afines de tiempo continuo – Procesos afines de tiempo discreto – Transformaciones de procesos afines – Estimadores GMM en procesos afines – Estimadores de máxima verosimilitud en procesos afines – Estimadores basados en funciones características.



BIBLIOGRAFÍA

Singleton, K. J., Empirical Dynamic Asset Pricing, Princeton University Press, 2006.

MODALIDAD DE LA EVALUACIÓN

Exponer dos trabajos propuestos por la cátedra a lo largo del curso.
Rendir examen final oral.