

***El Departamento de Estadística del ITAM***

anuncia la siguiente sesión de

***EL SEMINARIO ALEATORIO***

que con el título

***La Prima de Riesgo en el Mercado Interbancario Español: un Análisis con cambios de regimen en los Parámetros de la especificación ARCH.***

será impartida por el

***Profesor Nicolás Gómez C.  
ITAM Maestría en Finanzas***

***RESUMEN***

Este trabajo analiza la prima de riesgo en el mercado interbancario español. Ya que estudios previos sobre la prima riesgo con especificaciones ARCH encuentran una persistencia muy alta en la varianza, este trabajo trata de analizar si ésta puede ser debida a cambios en los parámetros. De manera específica se propone un modelo ARCH con cambios de regimen en los parámetros de la varianza condicional los cuales son favorecidos por los modelos de selección usados. El modelo también entrega una caracterización de la volatilidad como alta o baja que se verifican con los principales acontecimientos de esta economía.

***Fecha: Viernes 30 de Octubre***

***Hora: 12.30***

***Lugar: Salón 310, Río Hondo***

*El Seminario Aleatorio está destinado tanto a profesores como a estudiantes por lo que el Departamento de Estadística agradece a los profesores que colaboren invitando a sus alumnos a estas sesiones.*