

El Departamento de estadística del ITAM

anuncia la siguiente sesión de

EL SEMINARIO ALEATORIO

que con el título

Modelización econométrica de datos de alta frecuencia

impartirá

David Veredas

CORE Econometrics Group

Universit Catholique de Louvain

www.core.ucl.ac.be/econometrics/index.html

RESUMEN

Los datos de alta frecuencia, también conocidos por datos tick-by-tick han recibido una intensa atención en los últimos años. Desde la aparición del modelo ACD (Autoregressive Conditional Duration) de Engle y Russell (Econometrica, 1998), numerosas son las aportaciones anuales sobre este tema.

Los datos de alta frecuencia son, desde un punto de vista estadístico, un proceso puntual. Sin embargo los procesos puntuales financieros tienen todas las características patológicas de series financieras y por tanto nuevos métodos y modelos se requieren para su Análisis.

En esta charla se pretende dar una introducción de datos de alta frecuencia así como una revisión de los principales modelos que han aparecido hasta ahora y las posibles futuras tendencias investigadoras.

En primer lugar se explicará qué son estos tipos de datos y de dónde obtenerlos. Después se justificará su Análisis utilizando la Teoría de micro estructuras. En tercer lugar se definirá un proceso puntual y sus diversas formas de analizarlo. Esto dará paso a la modelización de un proceso puntual financiero, analizando sus características (dinámica, estacionalidad, etc.) y buscando modelos que las tomen en cuenta, como el ACD.

Finalmente se mostrarán aplicaciones con datos de NYSE y como pueden ayudar para comprobar la Teoría de micro estructuras.

Fecha Viernes 1 de marzo

Hora: 12:30

Salón: 311

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.