

SEMINARIO

MODELAMIENTO ESTOCÁSTICO

EXPOSITOR

Gonzalo Contador
University of Wisconsin Madison, USA

TITULO

Estimación de variación total y volatilidad en modelos unificados de GARCH-Ito con saltos.

Resumen:

Los modelos discretos de GARCH y continuos de Drift-Difusión son ampliamente utilizados en campos como finanzas y neurociencia. El modelo GARCH-Ito, introducido recientemente por Wang y Kim, superpone un modelo GARCH en tiempos discretos en el modelo de Ito para la volatilidad instantánea. En este trabajo, se propone una metodología conjunta para la estimación de la variación cuadrática para trayectorias con discontinuidades, utilizando criterios basados en Wavelets de Daubechies para estimación de magnitud y locación de saltos y una relación iterativa para la estimación de volatilidad integrada y se analiza el comportamiento de este procedimiento en presencia de data con ruido.

Miércoles 16 de enero a las 12:00 hrs, Sala de Seminarios John Von Neumann CMM, Torre Norte, 7mo piso de Beauchef 851.