

No si no las desdeño... (mira el finakl)

[rbotic] | 20:47, 2/Jul |

Como voy yo a desdeñar las matemáticas, ...

Simplemente soy exceptico en su uso con fines de especulación bursátil, pueden y son de un gran apoyo claro está, pero al final te sirven más de acompañante que de herramienta.

La bolsa no son matemáticas, un buen matemático no tiene porque hacerlo mejor que otra persona, podríamos discutir mucho al respecto...

La bolsa tiene de intuición, si pusieramos al supercomputador de turno a operar en bolsa obtendría unos resultados buenos pero no espectaculares.

Me vuelvo al Stochastic volatility models extensions.

1. Introduction (2 hours)

1.1 Empirical properties of financial time series

1.2 Stochastic volatility models. Properties

1.3 Pros and cons against ARCH models

1.4 Estimation: Parameters and volatilities

1.5 Empirical applications

2. Asymmetric Models (3 hours)

2.1 Leverage effect in financial time series

2.2 Asymmetric stochastic volatility models

2.3 Estimation

2.4 Empirical application

3. Long memory models (3 hours)

3.1 What is long memory?

3.2 Long memory stochastic volatility models

3.3 Estimation

3.4 Empirical application

4. Multivariate Models (2 hours)

4.1 interest in Multivariate Models

4.2 Multivariate stochastic volatility models