

Econometría Financiera e Introducción a la Administración de Riesgos

Imparte: Dra. María Rosa Nieto Delfín de la Universidad Anáhuac

Para el curso se utilizará el software R, se recomienda llevarlo instalado en sus computadoras personales ya que se usará desde la primera clase.

Tema 1. Medidas de riesgo: Valor en Riesgo y Medida de Riesgo Coherente

Tema 2. Estimación de medidas de riesgo con modelos univariados clásicos

Tema 3. Estimación de medidas de riesgo con procedimientos Bootsrpap.

Tema 4. Backtesting

Libro: McNeil, A. J., Frey, R., & Embrechts, P. (2015). Quantitative risk management: concepts, techniques and tools-revised edition. Princeton university press.