



Corso intensivo di “*Modelli per la volatilità delle attività finanziarie in GAUSS e EViews*”

Milano, (2 giorni), data prevista giugno 2007

TStat S.r.l., distributrice ufficiale dei software *EViews* e *GAUSS* in Italia, è lieta di annunciare il corso di “*Modelli per la volatilità delle attività finanziarie in GAUSS e EViews*”, che avrà luogo a Milano, giugno 2007.

PROGRAMMA

Il corso è suddiviso in quattro sessioni della durata di 3 ore ciascuna. Le sessioni includono una breve rassegna teorica, con riferimenti bibliografici, e un esauriente esercizio empirico.

- Modelli *GARCH* univariati e multivariati: specificazione, stima e scelta tra modelli.
- Modelli *Markov Switching* univariati e multivariati per le serie finanziarie.
- Modelli a volatilità stocastica univariati e multivariati
- Modelli per la volatilità realizzata.

SESSIONE I MODELLI GARCH

- Modelli *GARCH* univariati
- Modelli *GARCH* multivariati
- Applicazioni: *VAR*, *option pricing*, allocazione di portafoglio.

SESSIONE II MODELLI MARKOV SWITCHING E MARKOV SWITCHING GARCH

- Modelli *Markov Switching* per la volatilità.
- Modelli *GARCH* con *Markov Switching*
- Applicazioni: il meccanismo del “contagio” sui mercati finanziari

SESSIONE III MODELLI A VOLATILITA' STOCASTICA

- Modelli a volatilità stocastica univariati
- Modelli a volatilità stocastica multivariati
- Applicazioni: confronto con modelli *GARCH*
- Applicazioni univariate: misurazione del rischio, *pricing* di derivati

SESSIONE IV MODELLI PER LA VOLSTILITA' REALIZZATA

- Il concetto di volatilità realizzata.
- Utilizzazione di dati ad alta frequenza per la stima della volatilità realizzata
- Applicazioni empiriche

Il modulo di registrazione ed eventuali altre informazioni possono essere ottenuti da Lorena Romeo, tel. 0864 210101, email: corsi@tstat.it.