

80 AÑOS

INSTITUTO DE ESTADÍSTICA

90 años FCEA

Seminario del IESTA

Aplicaciones del modelo *Gaussian Affine Term Structure multidimensional* en la deuda soberana uruguaya.

Andrés Sosa ¹

Instituto de Estadística, Facultad de Ciencias Económicas y de Administración, Udelar

Resumen:

En la presentación se considera el problema de estimación de las curvas de rendimiento en la deuda soberana mediante la utilización de procesos estocásticos. En particular, utilizamos el modelo *Gaussian Affine Term Structure multidimensional* que presenta al proceso Ornstein Uhlenbeck como proceso subyacente. Este modelo de varias dimensiones presenta varias características buenas, en especial permite emplear adecuadas técnicas de estimación de parámetros de acuerdo a la información disponible en el mercado de renta fija. Esta manera de enfocar el problema, nos permite abocarnos en dos aplicaciones en la deuda soberana uruguaya: por un lado la valuación de una clase de derivados financieros y por el otro lado la generación de un índice riesgo país.

Miércoles 30 de marzo. Hora 14:00
Modalidad híbrida: Salón 4 y Zoom
ID Reunión Zoom: 876 4903 4326
Contraseña: S-IESTA-22

¹andres.sosa@fcea.edu.uy