**Guión de cuestiones Modelos ARCH univariantes y multivariantes**

* Modelos ARCH
	+ Propiedades estadísticas
	+ Primeras definiciones y propiedades
* El modelo ARCH(q)
* Modelos GARCH
* Modelo IGARCH
* Modelos asimétricos
	+ Modelo A-GARCH
	+ Modelo EGARCH(p,q)
	+ Modelo GJR
* Predicción de la varianza futura
* Modelos ARCH en media (ARCH-M)
* Contrastes de estructura ARCH
* Contrastes de especificación
* Estimación
	+ Imponiendo un nivel de volatilidad de largo plazo en la estimación: reversión a un nivel medio de volatilidad
	+ Estimación por Cuasi-máxima verosimilitud
* Contrastación de hipótesis
* Modelos multivariantes
	+ Modelos CC y DCC
	+ Factor GARCH models
	+ Orthogonal GARCH models
* Algunas aplicaciones de los modelos GARCH
	+ Option pricing
	+ Portfolio optimization