**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