



Título: UN ANALISIS FINANCIERO-ECONOMETRICO DE LA VOLATILIDAD DEL IBEX-35.

Nombre: RIVAS COMPAINS, FRANCISCO JAVIER

Universidad: Universidad de Zaragoza

Fecha de lectura: 01/01/1997

Programa de doctorado: DESCONOCIDO

Dirección:

> **Director:** LUIS FERRUZ AGUDO

Tribunal:

> **presidente:** ANDRÉS DE PABLO LOPEZ

> **secretario:** JOSÉ ANTONIO LAINEZ GADEA

> **vocal:** MARTIN MARIN JOSE LUIS

> **vocal:** SALVADOR CRUZ RAMBAUD

> **vocal:** PILAR CIBRAN FERRAZ

Descriptores:

> CIENCIAS ECONOMICAS

> ECONOMETRIA

> SECTOR DE FINANZAS Y SEGUROS

> ECONOMIA SECTORIAL

> SERIES TEMPORALES ECONOMICAS

El fichero de tesis no ha sido incorporado al sistema.

Resumen: LA TESIS REFERIDA ES UN TRABAJO ORIGINAL DE INVESTIGACION EMPIRICA EN EL CAMPO DE LA ECONOMIA DE LOS MERCADOS FINANCIEROS DE CAPITALES. POR OTRA PARTE, TAMBIEN LA INVESTIGACION CONLLEVA INTERACCIONES IMPORTANTES A NIVEL DE REVISION CRITICA DE DETERMINADOS ASPECTOS DEL MARCO CONCEPTUAL DE LA ECONOMIA FINANCIERA.

EN LA TESIS DOCTORAL A QUE SE HACE REFERENCIA SE HAN BUSCADO OBJETIVOS DE APORTACIONES NOVEDOSAS EN EL CAMPO DE LA ECONOMIA FINANCIERA, TANTO A NIVEL CONCEPTUAL O TEORICO COMO A NIVEL DE INVESTIGACION EMPIRICA.

CONCRETAMENTE SON MUY DESTACABLES LOS SIGUIENTES ASPECTOS



DE APORTACION ORIGINAL:

A) EL AMPLIO ANALISIS CRITICO DE LA VOLATILIDAD DE LOS
ACTIVOS FINANCIEROS, Y, MAS CONCRETAMENTE, DE LAS
VOLATILIDADES (HASTA SEIS DIFERENTES TIPOS DE VOLATILIDAD
SON ANALIZADAS) DEL IBEX-35.

B) LA MINUCIOSA, DETALLADA Y RIGUROSA MODELIZACION DE LAS
VOLATILIDADES DEL IBEX-35 EN UN CONTEXTO
FINANCIERO-ECONOMETRICO JUNTO CON LA COMPLEMENTARIA
INVESTIGACION EMPIRICA SOBRE UNAS LABORIOSAS Y PROFUNDAS
BASES DE DATOS.

C) LAS IMPORTANTES CONCLUSIONES QUE SE DERIVAN DEL
TRABAJO EN SU VERTIENTE DE INVESTIGACION EMPIRICA DE
VANGUARDIA EN ECONOMIA FINANCIERA APLICADA, TANTO A NIVEL
DE HIPOTESIS, MODELIZACIONES, Y APLICACIONES
TECNICO-OPERATIVAS PARA GESTION DE CARTERAS.