

Taller Riesgos y Coberturas

Este taller es de cuatro personas. Escoja cuatro acciones de su preferencia una por cada integrante, descargue los precios de cada acción en tres períodos de tiempo diferentes

- Enero y diciembre de 2019
- Abril de 2019 y abril de 2020
- Agosto de 2019 y agosto de 2020

Realice los siguientes puntos con cada acción y cada uno de los períodos:

1. Obtenga la volatilidad histórica, EWMA y Estocástica para una ventana de 20 días
2. Grafique los histogramas de cada una de las series
3. Obtenga la media, el coeficiente de asimetría y la curtosis de cada uno de los períodos
4. Genere el portafolio de mínima varianza con cada medida de volatilidad en cada uno de los períodos. En total deben salir 9 portafolios diferentes.
5. Obtenga el promedio de rendimientos de cada portafolio, la desviación estandar y los pesos.
6. Compare los resultados y busque definir en que momento es prudente implementar cada metodología

Este taller se puede entregar en excel con su archivo en word o en R con su archivo en html.

En la siguiente clase se expondran los resultados