

Proyecto de Mitad de Semestre

Econometría Financiera

Universidad de La Salle

2019/02

1. Introducción

Este trabajo busca que usted compruebe la relación entre dos series de tiempo de su elección, estableciendo una pregunta basados en la teoría económica y financiera en donde debe resolver esa pregunta usando solo los conceptos aprendidos en clase.

Usando dos conjuntos de datos de series de tiempo de su elección, realice un análisis de series de tiempo, aprovechando lo aprendido hasta ahora en este curso.

Escribir un informe, como un archivo de notas de R (Rmd). El archivo Rmd debe leer los datos directamente desde una fuente de Internet y se debe ser enviado por correo. Las dos series de tiempo deben estar relacionadas basados en criterios económicos y financieros y estas deben ser respaldadas por regresiones lineales usando métodos de correlación cruzada.

2. Datos:

La serie de tiempo debería tener al menos 100 observaciones. Puede tener menos, si sus intereses lo exigen. Los datos más cortos requieren atención adicional, ya que los diagnósticos de modelos y las aproximaciones asintóticas se vuelven más delicados en los conjuntos de datos pequeños. Si sus datos son más largos ejemplo 1000 observaciones, puede realizar una submuestra. Sus datos no pueden ser los mismo de los de otro grupo.

Hay algunas pautas generales que puede usar para averiguar qué información incluir en un panel, por ejemplo:

- ¿Qué información está cambiando relativamente rápido?
- ¿Qué información es la más importante para su misión? Si es una empresa, las cosas como el dinero o los usuarios probablemente serán muy importantes, pero si desea implementar una política económica o financiera que debería mirar primero.
- ¿Qué afectará las decisiones que usted u otros deberán tomar? ¿Está ejecutando la pruebas econométricas que necesita para elegir el modelo ?
- ¿Hay algún factor externo que pueda afectar su investigación?.
- ¿Qué cambios ha hecho? han afectado los resultados , ¿Representa mejor la idea que usted desea mostrar?.

2.1. Expectativas del trabajo

- Debe explicar algunos antecedentes de los datos que eligió y motivar al lector a apreciar el propósito de su análisis de datos.
- Uso de métodos estadísticos y econométricos adecuados.
- Los modelos y métodos que utilice deben explicarse completamente, ya sea por referencias o dentro de su informe. Cuando use una referencia para señalar al lector las descripciones de sus gráficas, debe proporcionar un breve resumen en su propio informe para que sea autónomo. Aunque va a enviar su código fuente, no debe esperar que el lector lo estudie.
- Centrarse en unos pocos datos, cuidadosamente explicados y justificados con ayuda de figuras, tablas, estadísticas y pruebas de hipótesis. Es posible que desee probar muchas cosas, pero solo escriba evidencia que respalde cómo los datos lo ayudan a obtener de su pregunta sus conclusiones. La inclusión de material que no es de relevancia o que no se explica completamente, hace que sea más difícil para el lector apreciar su análisis.

3. Método de calificación

El método de calificación se divide en 5 partes cada una con un número de puntos de acuerdo a la importancia dentro del trabajo.

3.1. Introducción del trabajo 6 puntos

La introducción debe proporcionar antecedentes de los datos que analiza y motivar al lector a apreciar el propósito de su análisis de datos.

6-5 puntos si, la pregunta está claramente explicada y está relacionada con una pregunta alrededor del análisis económico.

4-3 puntos si, la motivación es débil pero no ausente.

2-1. puntos si, no intenta explicar por qué se eligieron los datos o cuál es el propósito de realizar un análisis estadístico de los mismos.

3.2. Aplicación de las herramientas de forma apropiada 15 puntos

15-11 puntos si, se utilizaron apropiadamente una serie de métodos de series de tiempo. La elección de los métodos es impulsada por los objetivos del proyecto.

10-6 puntos si, se utiliza una variedad de métodos de series de tiempo, probando los métodos descritos en las notas sin prestar atención a su rol particular en los objetivos del proyecto.

5-1 puntos si, no aplican métodos relevantes del curso, o métodos irrelevantes aplicados.

3.3. Armonía en la presentación del documento usando referencias externas 10 puntos

10-7 puntos si, Las referencias se utilizan para respaldar aspectos del informe no son independientes. Es comparable a lo que se espera en un artículo académico publicado.

6-4 puntos si, Se intenta hacer referencias y seguir el estilo de la redacción académica.

3-1 puntos si, No hay referencias y la redacción no es buena.

3.4. Conclusión 3 puntos

3 puntos si, Se percibe una conclusión clara refiriéndose a resultados a partir del documento

2 puntos si, Existe una conclusión basado en el proceso del documento.

1 punto si, Hay una conclusión pero sin conexión con los resultados.

3.5. Presentación 6 puntos

6-5 puntos si, Las figuras, tablas y resultados de las pruebas se discuten y explican adecuadamente. Para cada resultado presentado, queda claro cómo contribuye esto al desarrollo hacia las conclusiones del documento.

4-3 puntos si, La presentación en su mayoría es adecuada, pero con un espacio sustancial para la mejora.

2-1 puntos si, Presentar una lista de análisis realizados, sin mucha atención a explicar qué se hizo y por qué.

4. Entrega de resultados y Otros

- La entrega del primer corte es un análisis de las series de acuerdo a lo aprendido en clase en un documento de no más de cinco hojas con un proceso descriptivo de las series en términos gráficos. Ese documento debe contener la introducción que nace de la evaluación de la serie de tiempo en donde se establece la pregunta que se desea resolver. En lo posible esta pregunta debe estar sustentada de acuerdo a una teoría económica o financiera que debe ser el primer artículo referenciado dentro del proyecto.
- El día de la entrega de este primer documento es el acordado en clase.
- Se debe generar un archivo HTML creado en R y el archivo markdown RMD que resuma todo el trabajo.
- El trabajo no debe tener más de diez hojas.
- Tanto el archivo RMD como el HTML se deben enviar al correo.
- Máximo cuatro personas por grupo.
- El día de la entrega es el acordado en clase.
- La presentación se hace una clase antes del parcial.