

Mini proyecto-Tarea

Se adjunta una base de datos que posee precios diarios de 5 activos diferentes. El proyecto consiste en obtener el VaR del portafolio cómo se realizó en clase (Paramétrico normal Multivariada) y obtener el VaR de cada activo cómo viene en la presentación (slide 4).

Datos: $\alpha = \{0.01, 0.05, 0.1\}$

Deberán utilizar las alphas escritas para el nivel de confianza, y describir las conclusiones que se obtengan cuando se cambian de alpha para el mismo portafolio y Activos además indicar cómo es el VaR de cada Activo respecto al del Portafolio (para un mismo Alpha).

Si entregas el correo en R-Markdown. Debe entregarse (enviarse por correo) el código r.markdow y el respectivo archivo pdf generado.

Si entregas el proyecto en Excel. Deberás enviar el archivo de Excel y un archivo pdf con lo que se pide anteriormente (análisis del VaR)

Fecha de entrega viernes 1° de mayo de 2020 hasta las 11:59

En el asunto del correo deberán poner: "Proyecto VaR Métodos 2020-2"

Enviar a

jhdcs@ciencias.unam.mx

natael@ciencias.unam.mx

luis2098@ciencias.unam.mx