

# Proyecto 1

Cebada Santana, Cesar

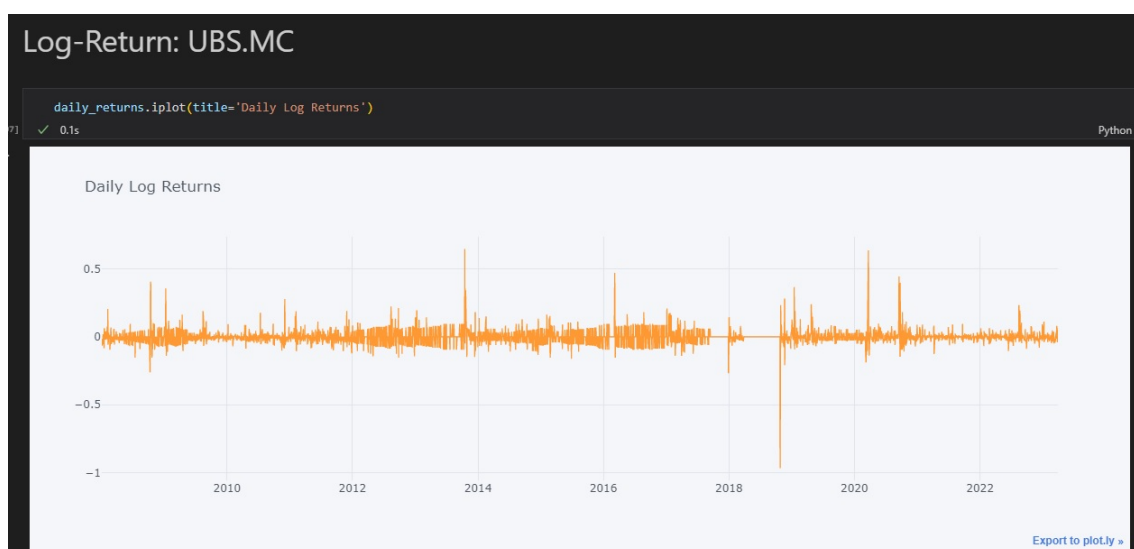
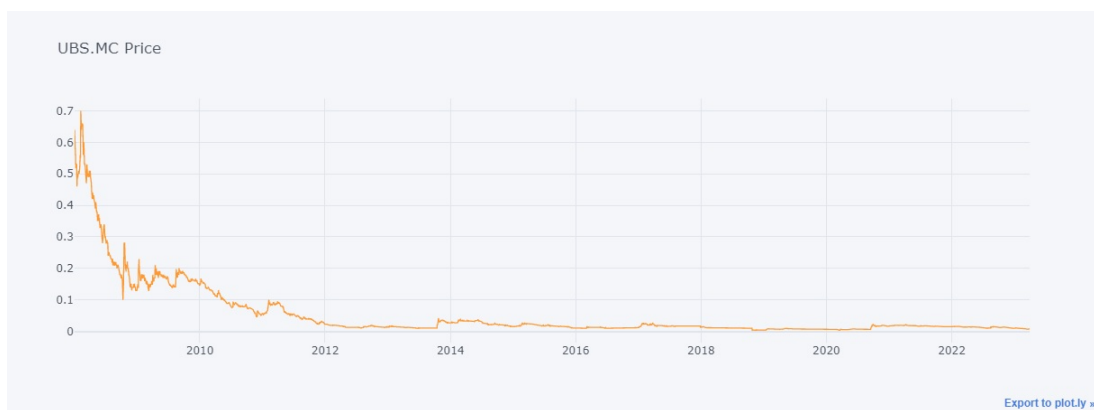
## a) Se describe el activo de mi elección.

Escogí el activo de Urbas Grupo Financiero (UBS.MC) ya que me pareció interesante el decrecimiento que tuvo de 2010 a 2014 en su serie de tiempo y su varianza un poco constante.

Urbas Grupo Financiero es una empresa española que cotiza en la Bolsa de Madrid con el código de cotización "UBS". La empresa se dedica principalmente al desarrollo de proyectos inmobiliarios y de infraestructura.

Urbas tiene una presencia significativa en el mercado inmobiliario español y ha desarrollado una variedad de proyectos, incluyendo urbanizaciones, edificios de oficinas, centros comerciales y residenciales. Además, también tiene proyectos en otros países como Marruecos y México.

La empresa ha experimentado altibajos en su historia, con dificultades financieras en el pasado. Sin embargo, ha implementado cambios importantes en su estrategia empresarial y ha logrado recuperar la confianza de los inversores en los últimos años.

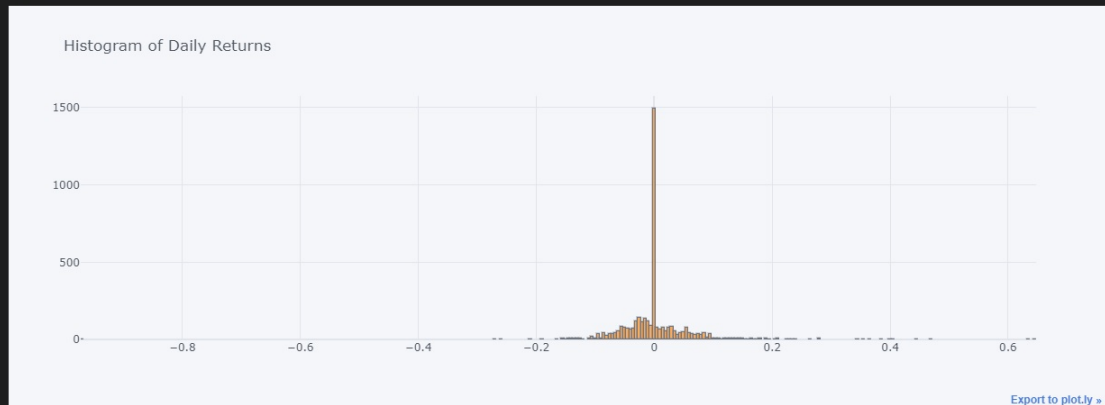


## Histogram: UBS.MC

```
daily_returns.iplot(kind='histogram', title = 'Histogram of Daily Returns')
```

✓ 0.1s

Python

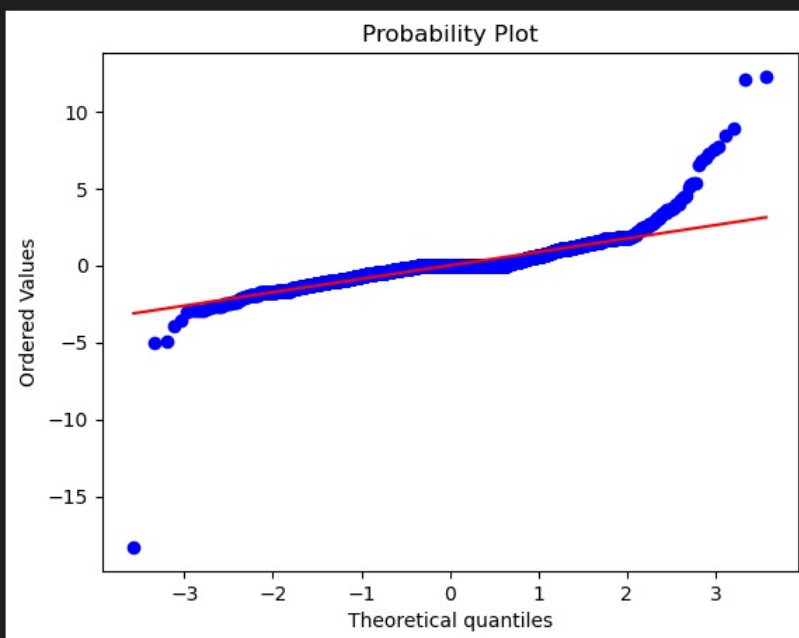


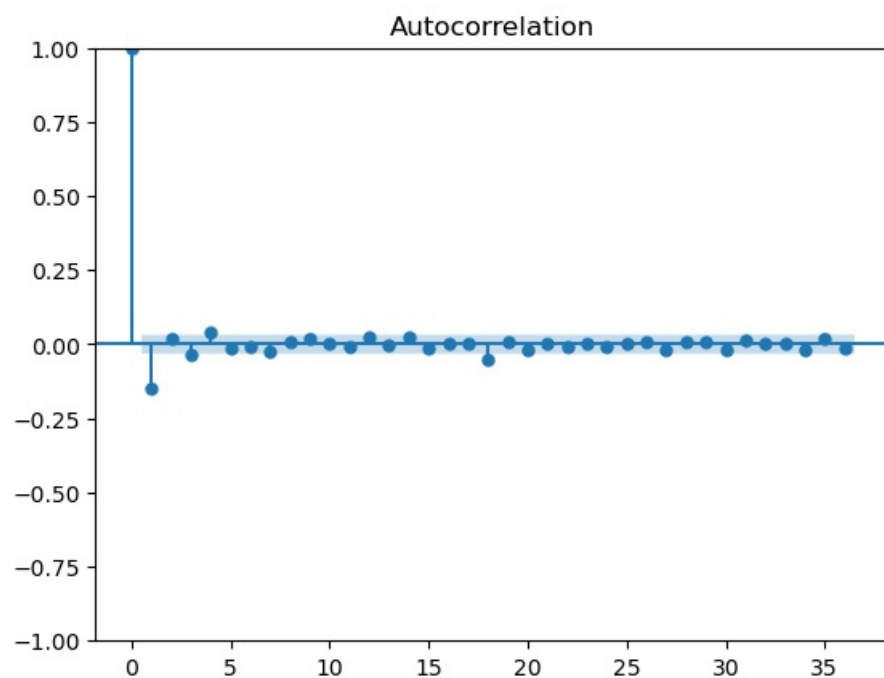
[Export to plot.ly »](#)

## QQ-Plot: UBS.MC

```
stats.probplot((daily_returns-np.mean(daily_returns))/np.std(daily_returns), dist="norm", plot=plt)  
plt.show()
```

✓ 0.1s

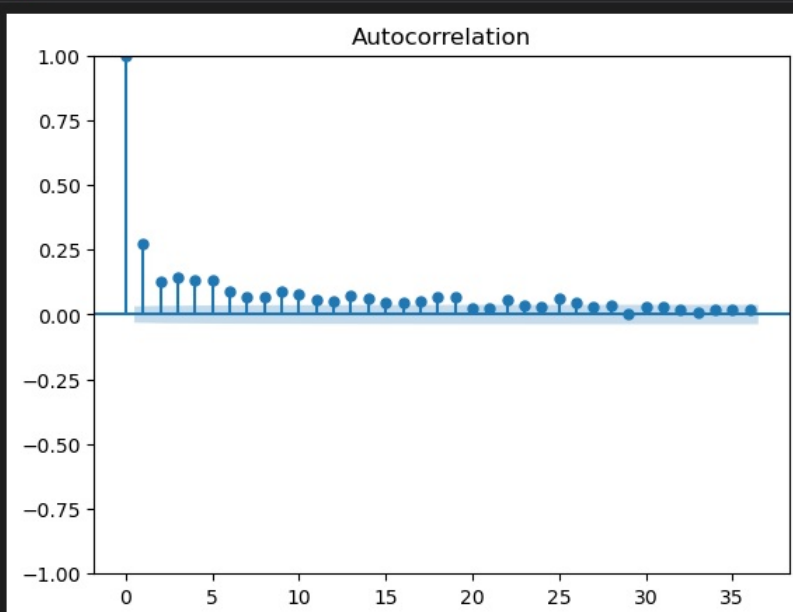




## ACF: Absolute-UBS.MC

```
# plot the auto correlation
plot_acf(np.abs(daily_returns))
```

✓ 0.3s



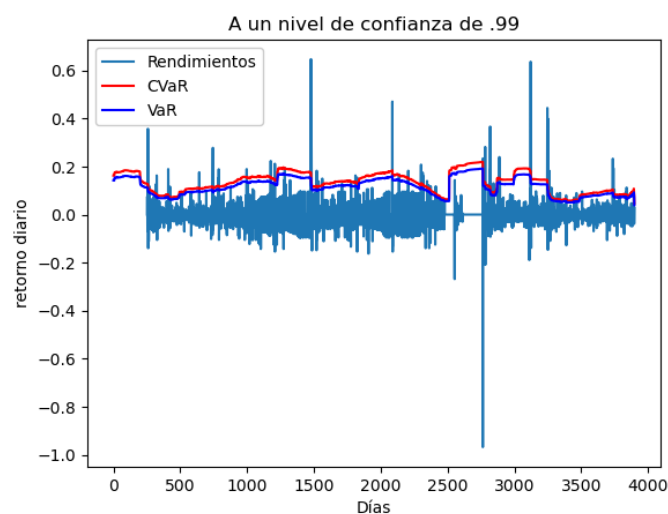
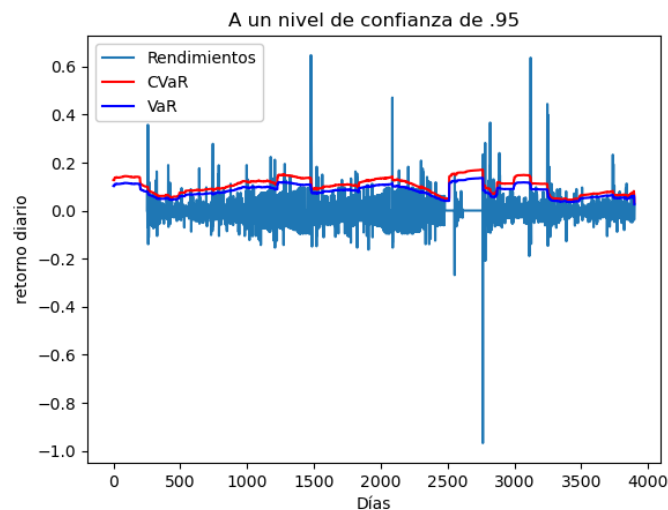
b) Se reporta la media, sesgo y exceso de curtosis.

	Mean	SD	Kurtosis	Skew
Statistics	-0.00078	0.05437	51.47616	0.29107

c) Se muestran los resultados de los cálculos.

	VaR (Parametrico) distribucion normal	VaR (MonteCarlo) distribucion normal	CVaR (Parametrico) distribucion normal	CVaR (Monte Carlo) distribucion normal	VaR (Parametrico) distribucion t	VaR (MonteCarlo) distribucion t	CVaR (Parametrico) distribucion t	CVaR (Monte Carlo) distribucion t	VaR (historico)	CVaR (historico)
95% de Confianza	8.524794	8.488497	10.775839	10.707359	8.547404	8.569421	11.378778	10.707359	4.736678	7.270112
975% de Confianza	10.222322	10.212384	14.021568	13.664601	10.257546	10.278008	14.524849	13.664601	6.066628	9.100375
99% de Confianza	12.196065	12.175118	14.021568	13.664601	12.251487	12.412257	14.524849	13.664601	9.437228	11.515585

d) Resultados gráficos.



e) Tabla de confianza

	Nivel de confianza	Violaciones de Var	Violaciones de CVar	Violaciones de Var en porcentaje	Violaciones de CVar en porcentaje
0	95%	123	76	3.371711	2.083333
1	99%	61	44	1.672149	1.206140