

# Trabajo Práctico II - Macroeconomía 2

Curso a cargo de Damián Pierri

Noviembre 2024

## Instrucciones

1. Fecha de entrega: 23/11/2024
2. Forma de entrega: En no más de una carilla de Word, entregar a la carpeta especificada en el campus.

Consigna 1 En principio, obtenga los retornos intermensuales ( $\frac{P_i - P_{i-30}}{P_{i-30}}$ ) de 5 acciones del merval. Luego, calcule la matriz de covarianzas y varianzas, ¿Cual es el problema que identifica?

Consigna 2 Entre julio y agosto, el retorno de los activos CER alcanzó a rendir entre 16 y 18% , con lo cual ofrecia un retorno esperado elevado siendo. Teniendo en cuenta lo estudiado (un mayor retorno implica una mayor volatilidad del consumo), ¿Cuales eran las expectativas que justificaban estos rendimientos? (Pista: Pensar la relacion entre el ingreso y los rendimientos de dichos activos).