

EST-46114 Métodos Multivariados
Primavera 2019
Tarea 04
Fecha de entrega: 19/Mar/2019

Nombre: _____
C.U.: _____
12/Mar/2019

Consideren la sesión del 12 de marzo del curso.

1. Desarrollen los scripts en R para calcular el $DIC(m)$ de los siguientes combinaciones de modelos de factores para los datos de tipos de cambio (USD):
 - Modelos de factores con $k = 1, 2$
 - Modelo de factores estático (medias cambiantes)
 - Uno de los modelos dinamicos (en medias o, preferentemente, en volatilidad estocástica).

Es decir, el número M de modelos es igual a 4.

2. Comparen los 4 modelos e identifiquen cuál modelo es el más adecuado.

Entreguen sus soluciones en un archivo `*.Rmd`. Gracias.