

MUIF

Series Temporales HW 03: BMW vs Volkswagen

©Ricardo A. Queralt

Versión 1.12

Este documento ha sido preparado por Ricardo A. Queralt, profesor de Métodos Cuantitativos para ser utilizado como material de análisis y estudio. De ninguna forma pretende ilustrar recomendaciones de actuación sobre las empresas, las situaciones, o las personas mencionadas en el documento. Las propuestas conceptuales, opiniones y análisis que aparecen en este documento son responsabilidad del autor y, por lo tanto, no necesariamente coinciden con las de CUNEF.

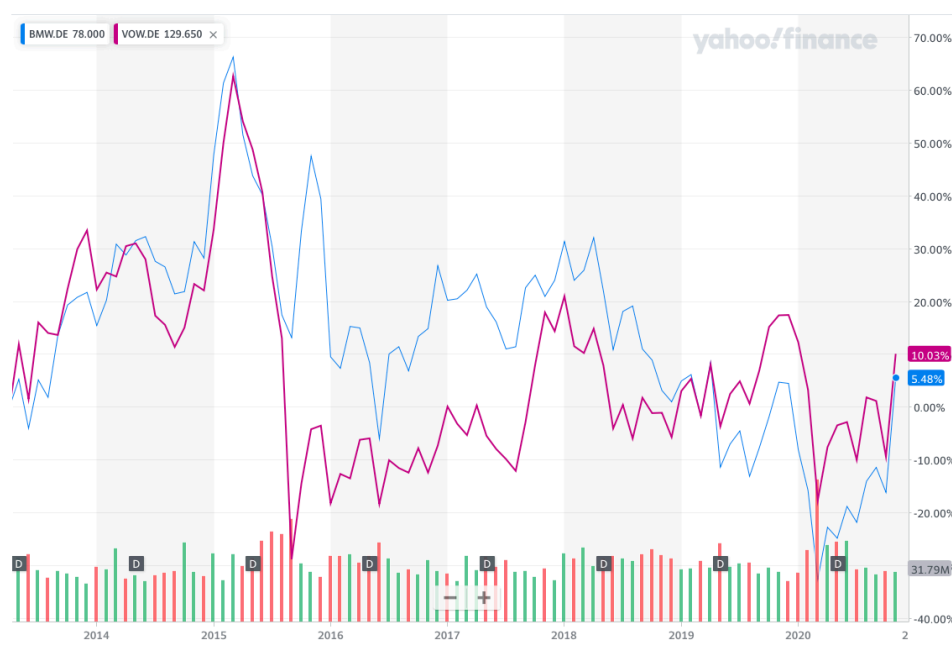
Este documento no podrá ser reproducido, almacenado, utilizado o transmitido por ningún medio (fotocopia, copia digital, envío electrónico,...) sin autorización escrita del autor y/o CUNEF

©Ricardo A. Queralt & CUNEF.

Secciones

1	Introducción	1
---	------------------------	---

Sección 1. Introducción



Introducción

Utilizando datos diarios de yahoo de los dos series (yfinance), debemos analizar la relación entre BMW (BMW.DE) y Volkswagen(VOW.DE), contestando a las siguiente preguntas:

- ★ Estima un modelo VAR mensual entre los dos activos. (Muestra:2009/01 a 2020/10)
- ★ ¿Cuál es la predicción para octubre de 2021 de los dos activos?. ¿Son buenas predicciones?
- ★ ¿Cuál de los dos activos es el lider y cual es el seguidor?
- ★ ¿Es la Volatilidad de BMW constante? Estimar el modelo garch de BMW (Muestra: Toda la disponible en Yahoo hasta el 31/10/2020)
- ★ ¿Cuál es la predicción para el mes de noviembre de 2020? ¿Son buenas predicciones?
- ★ Plantea un sistema de trading diario para BMW a partir del modelo Garch para el mes de noviembre de 2020. ¿Es rentable?