

c15
filippo
18 May 2018

Esercizio 15.

I file `haliburton.txt` e `macdonalds.txt` contengono i rendimenti mensili sulle azioni di queste due compagnie dal 1975 al 1999.

(a)

Si analizzino i dati per evidenziare se vi sono dati anomali.

(b)

Si adatti una distribuzione parametrica ai dati chiarendo le ipotesi sottostanti.

(c)

Si confronti la distribuzione parametrica stimata con la distribuzione empirica.

(d)

In finanza si è interessati alla volatilità del titolo misurata attraverso la sua varianza e il suo scarto interquartile. Si calcoli una stima delle due quantità.

(e)

Quale delle due compagnie risulta più variabile ?

(f)

Si utilizzi il bootstrap non parametrico per ottenere un intervallo di confidenza per lo scarto interquartile.

(g)

Si utilizzi il bootstrap parametrico per ottenere un intervallo di confidenza per lo scarto interquartile.