

Trabajo No 2 de Econometría Financiera

Filtros lineales, Procesos ARMA, SARMA

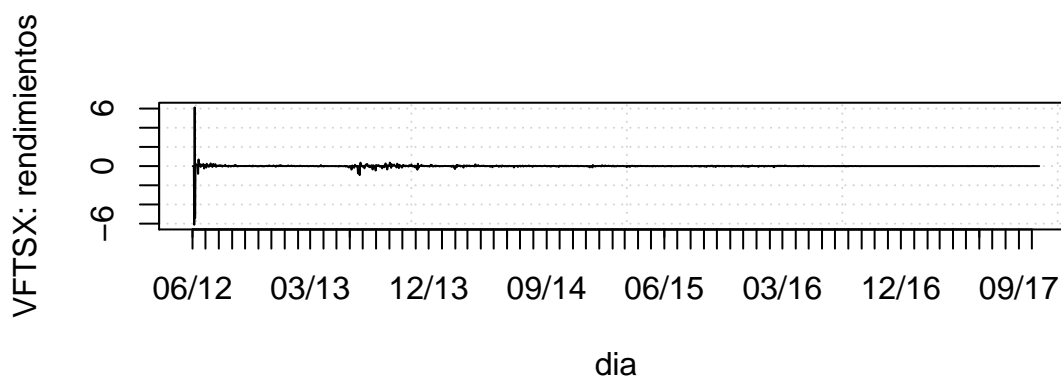
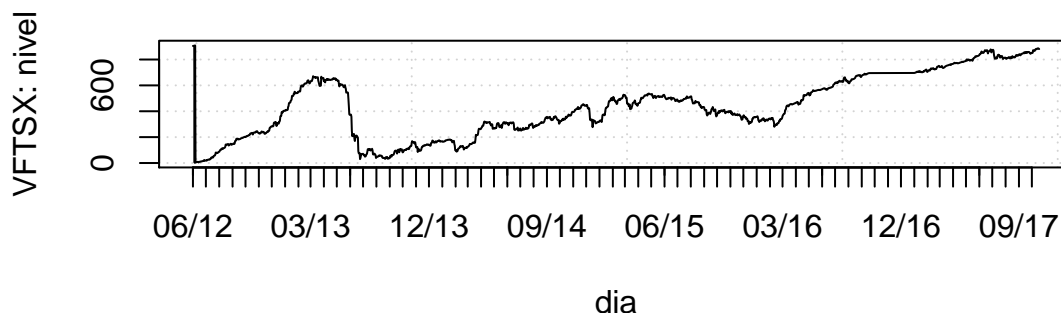
Ana María López - Pedro Pablo Villegas

Octubre, 2017

OBJETIVO

El objetivo del trabajo es examinar procedimientos para decidir en cual de dos fondos (o activos) invertir. Cual proporciona una mejor alternativa. El analisis se basa en los modelos ARMA ajustados a las series de tiempo de los rendimientos de ambos fondos. Por lo que este es un paso que debe procurar el mejor modelo posible. Cada grupo tiene asignada dos (2) series con el valor de la unidad de un fondo de inversiones, en la Seccion 4, tomadas de la pagina de la SuperFinanciera. El paso inicial es calcular los rendimientos logaritmicos de ambas series.

1. (30%) Ajuste modelos ARMA. Para ambas series de rendimientos encuentre el modelo ARMA que mejor ajusta. Reporte en cada caso: 1) identificacion (fac,facp) y otros procedimientos de identificacion. 2) resultado de la estimacion (tabla coeficientes con estadisticos tStudent), 3) analisis de ruido blanco de los residuos. 4) prueba de ajuste con densidad espectral.



REFERENCIAS