



UNIVERSIDAD
NACIONAL
DE COLOMBIA

TALLER SEMANAL #6

ECONOMETRÍA FINANCIERA
PROGRAMA DE ECONOMÍA

SEMESTRE 2021 - 1

Los talleres semanales deben ser entregados de forma individual y serán sustentados de forma oral. Estos representan un 25% de la nota final del curso. Esta nota depende de que se hayan entregado la totalidad de los talleres y de la sustentación oral del estudiante. Si el estudiante sustenta varias veces durante el curso la nota corresponderá al promedio simple. La entrega se debe hacer escaneando la solución escrita de puño y letra del estudiante y enviandola al correo kgomezp@unal.edu.co

Son las siguientes afirmaciones Falsas o Verdaderas. Sustente y explique su respuesta. Un mercado eficiente débil puede ser visto como un paseo aleatorio (RW) ya que los cambios en los precios históricos están reflejados en los precios actuales, siendo este el argumento para testear la aleatoriedad en el mercado. Sin embargo, si el mercado fuera completamente aleatorio los inversionistas no tendrían incentivos para invertir ya que no sería compensados por el riesgo que asumen en el mercado.

1. Lo anterior es Falso o Verdadero ? Discuta su respuesta.