



UNIVERSIDAD
NACIONAL
DE COLOMBIA

TALLER SEMANAL #2

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

1. Si una inversión tuvo un retorno simple (o discreto) durante 4 años del 36%. Se puede concluir que el retorno anual fue del 9%? Explique su respuesta.
2. Si el log retorno mensual de un activo es 4.46%. Cuánto es su retorno simple mensual ?
3. Asumiendo que el retorno continuo de un activo es en promedio igual a cero. Cuál sería su varianza ?
4. Considere los siguientes log retornos diarios: $-0.14, -0.15, 0.46, -0.02, 0.09$. Cuál sería su desviación estándar promedio diaria ?
5. Si un activo tiene log retornos mensuales 4.46%, -7.34%, and 10.77%. Cual es el retorno trimestral?