




Comentarios trabajo Caso Data Analytics 25/26

Desde Catalina Bolance Losilla <bolance@ub.edu>

Fecha Mar 23/12/2025 17:29

Para VÍCTOR MANUEL PÉREZ <vperezpe12@alumnes.ub.edu>

CC Maria De Las Mercedes Ayuso Gutierrez <mayuso@ub.edu>

 1 archivo adjunto (788 KB)

FC01_G03_Entrega02_mag.pdf;

Hola Víctor, te adjunto el pdf con comentarios de la profesora Mercedes Ayuso sobre vuestro documento y a continuación te pongo los míos.

En lo que respecta a la parte de cuantificación de riesgos, habéis hecho un buen trabajo. En las Tablas y cuadros tenéis que especificar mejor a lo que se refiere. Por ejemplo, en los cuadros 2 y 3 ponéis modelización no paramétrica (cuales: empírica, kernel, kernel transformado). Tampoco indicáis que son los valores en la primera fila del Cuadro 3. En general, cada título de tabla debe ser más explícito. Si son modelos multivariantes, son cópulas, son mixtura de normales... También estaría bien añadir una tabla comparando todos los resultados del VaR con todos los modelos y métodos que habéis implementado. Añadir también la comparación de la suma de los VaRs de X_1 y X_2 y con los VaRs obtenidos con los distintos modelos bivariantes.

Saludos,
Catalina

Dr. Catalina Bolancé
Department of Econometrics, Statistics and Applied Economics
Riskcenter-IREA
University of Barcelona
Diagonal, 690
08034 Barcelona, Spain
Phone: +34 93 4024320
Fax: +34 93 4021821
E-mail: bolance@ub.edu