

Apéndice Online: ¿Cómo se siente el presidente?*

Erika Kleiman Tomás Pacheco Abigail Riquelme

30 de junio de 2021

1. Pronósticos

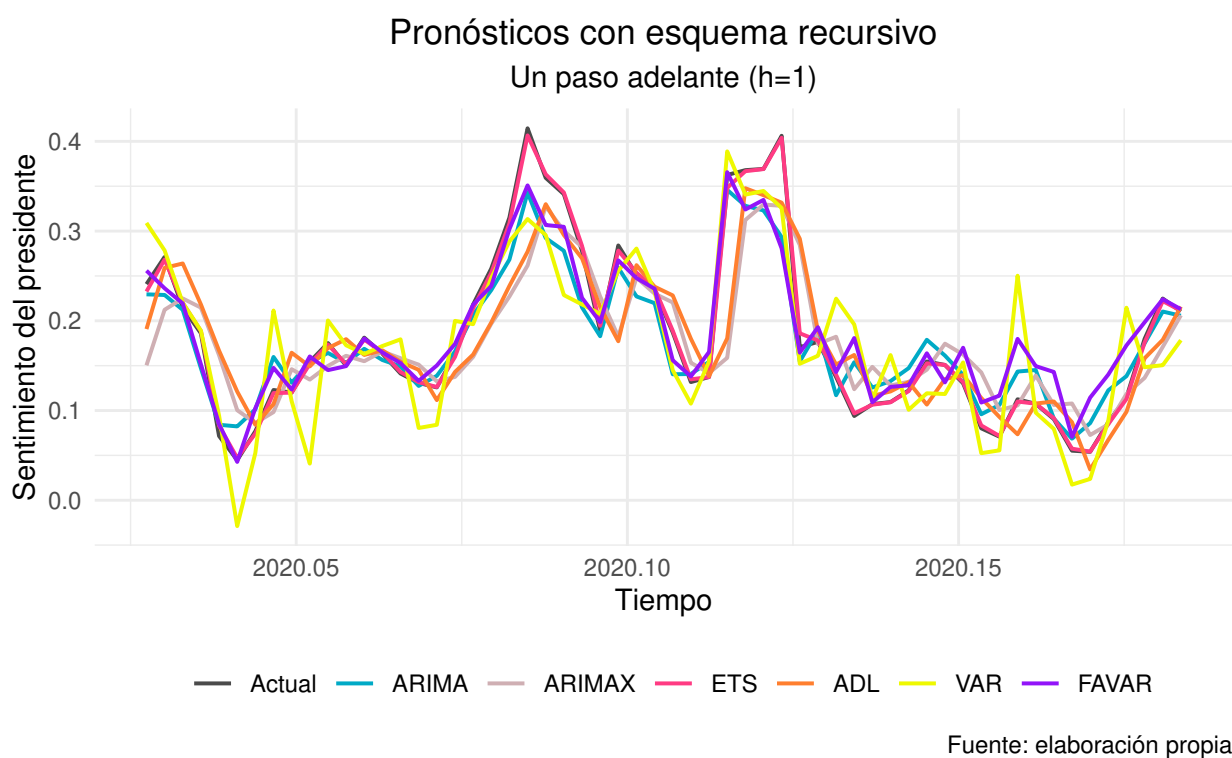


Figura 1: Pronósticos

*Trabajo Final para la materia Pronósticos Financieros de la Universidad de San Andrés, semestre de otoño 2021. Profesora Magdalena Cornejo.

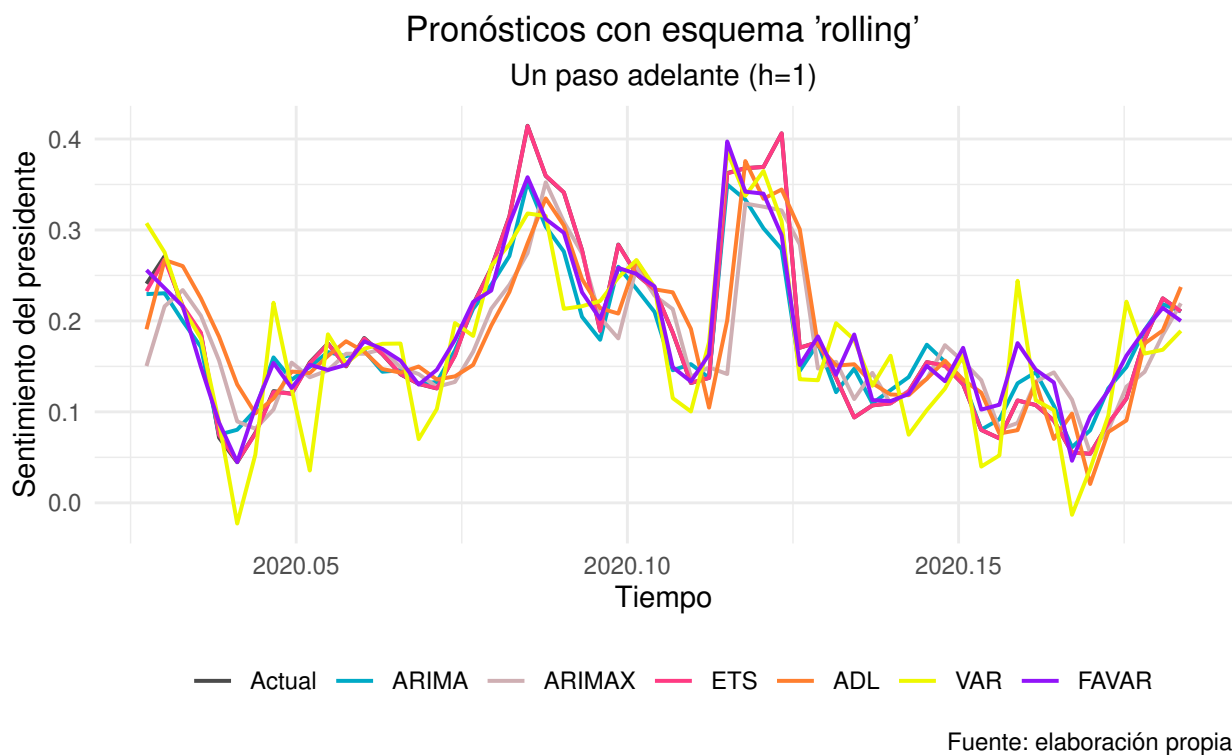


Figura 2: Pronósticos

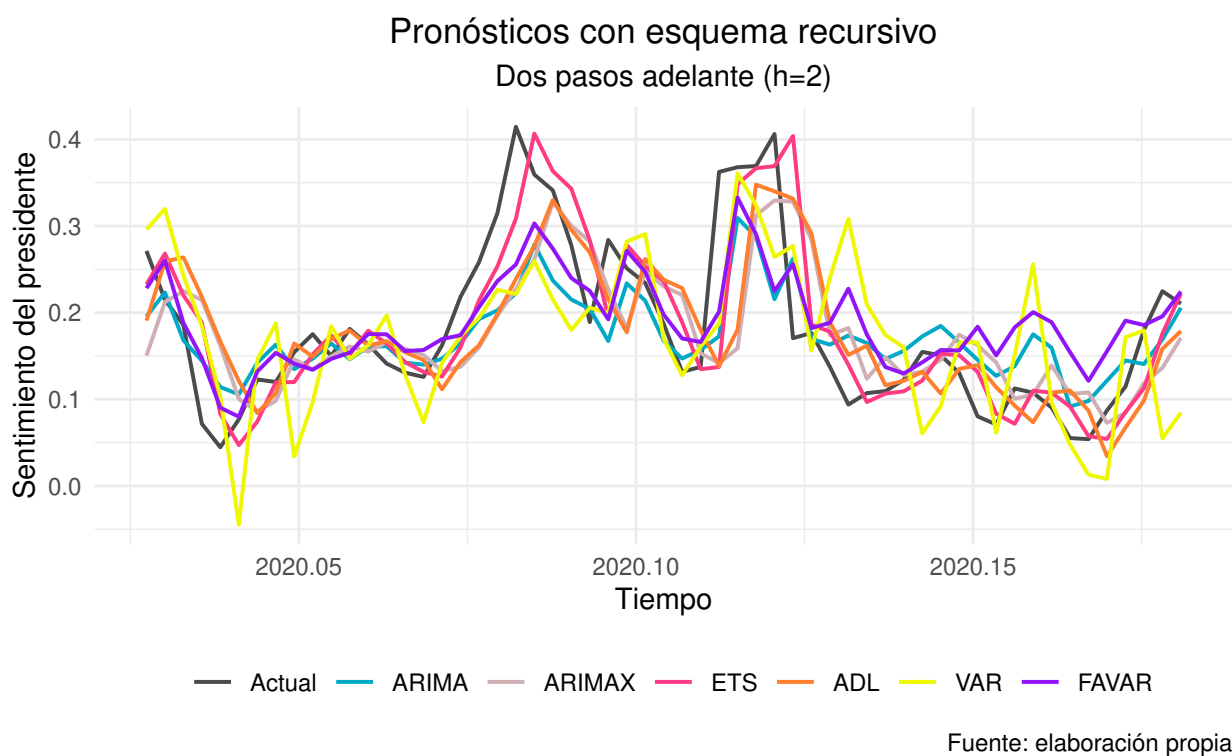


Figura 3: Pronósticos

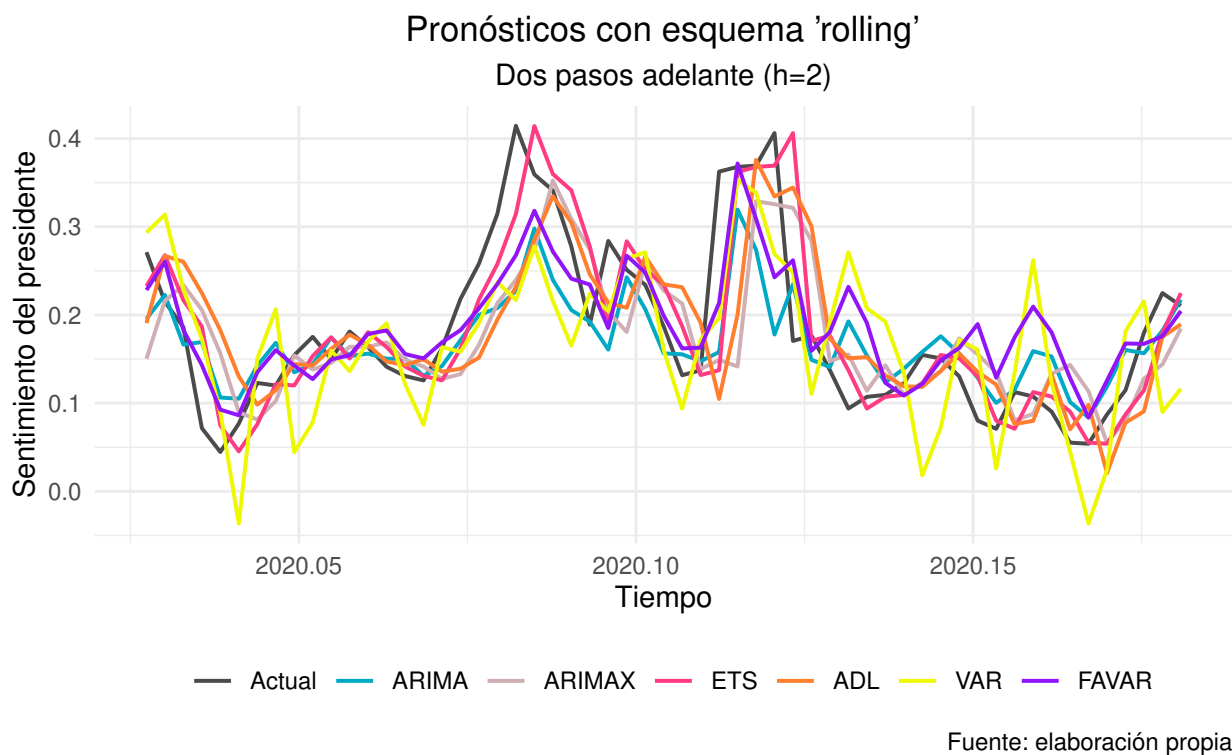


Figura 4: Pronósticos

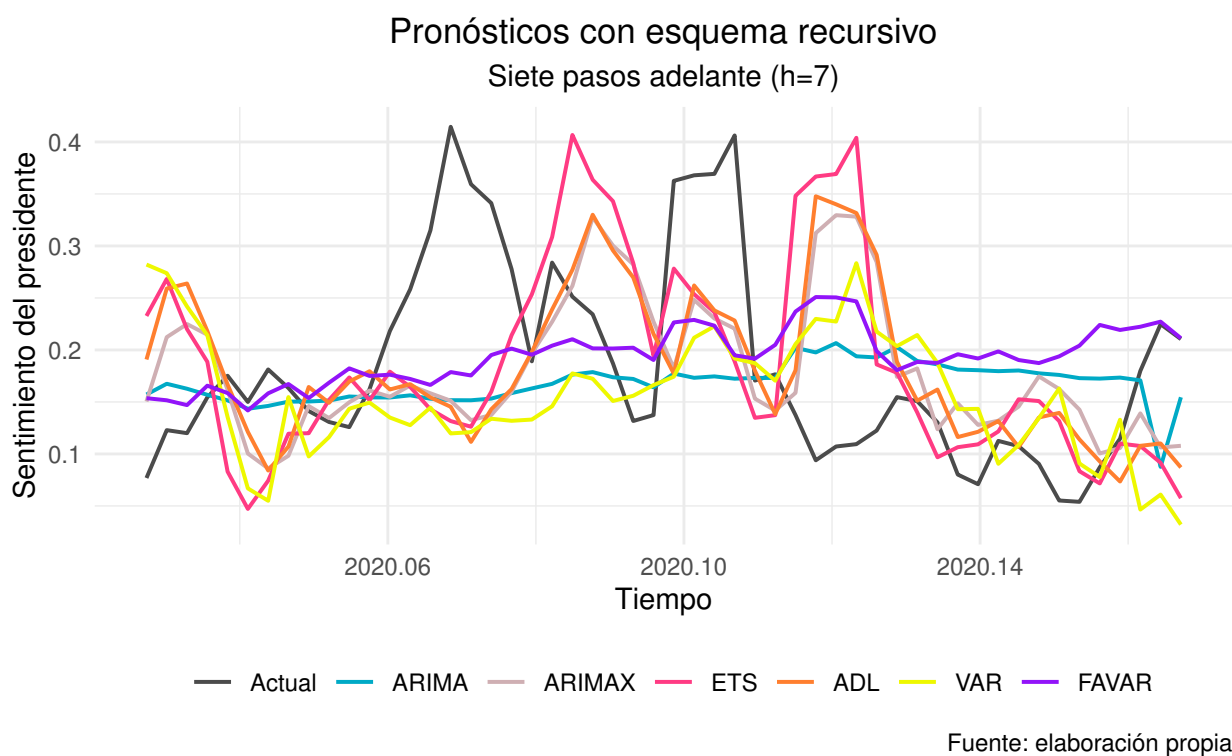


Figura 5: Pronósticos

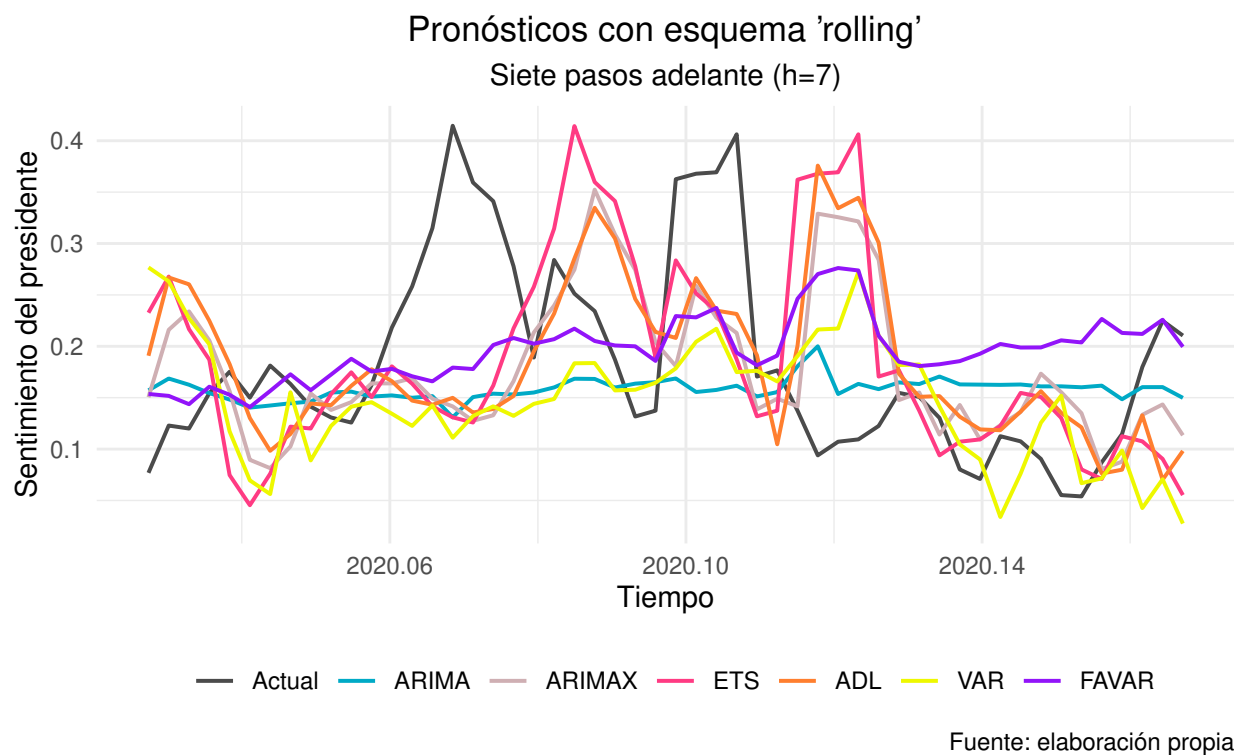


Figura 6: Pronósticos

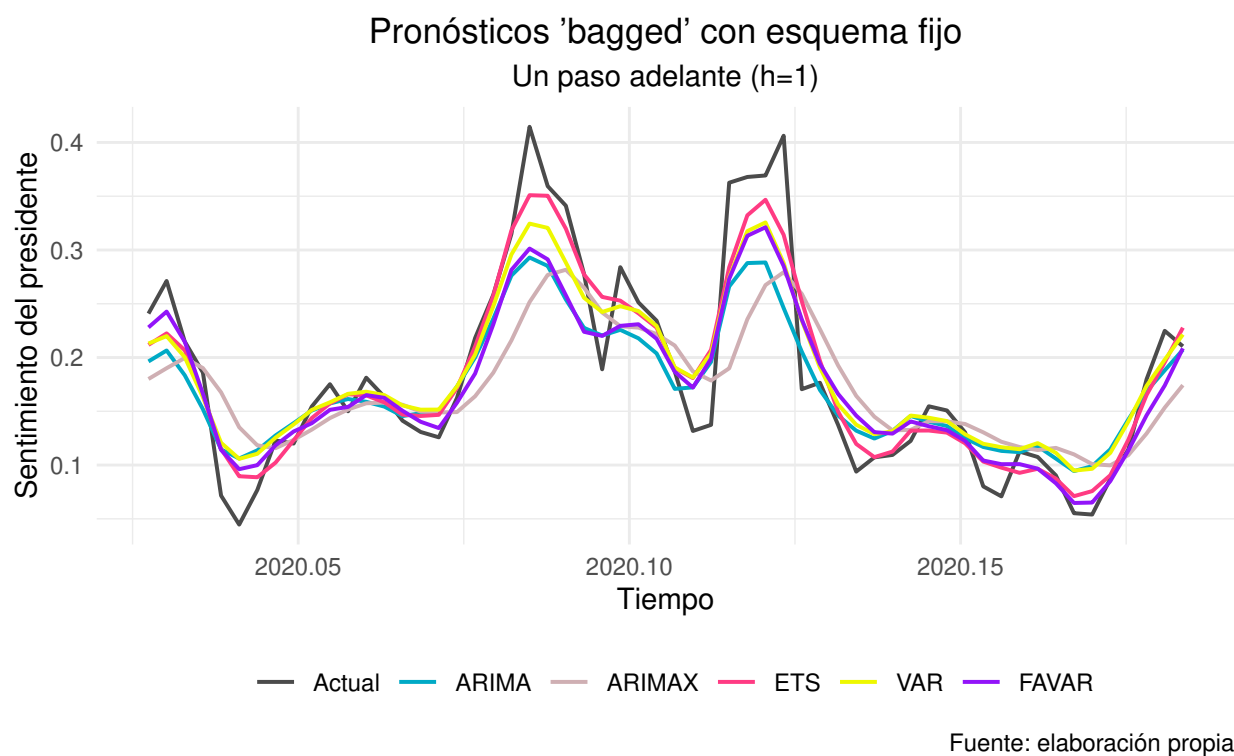


Figura 7: Pronósticos

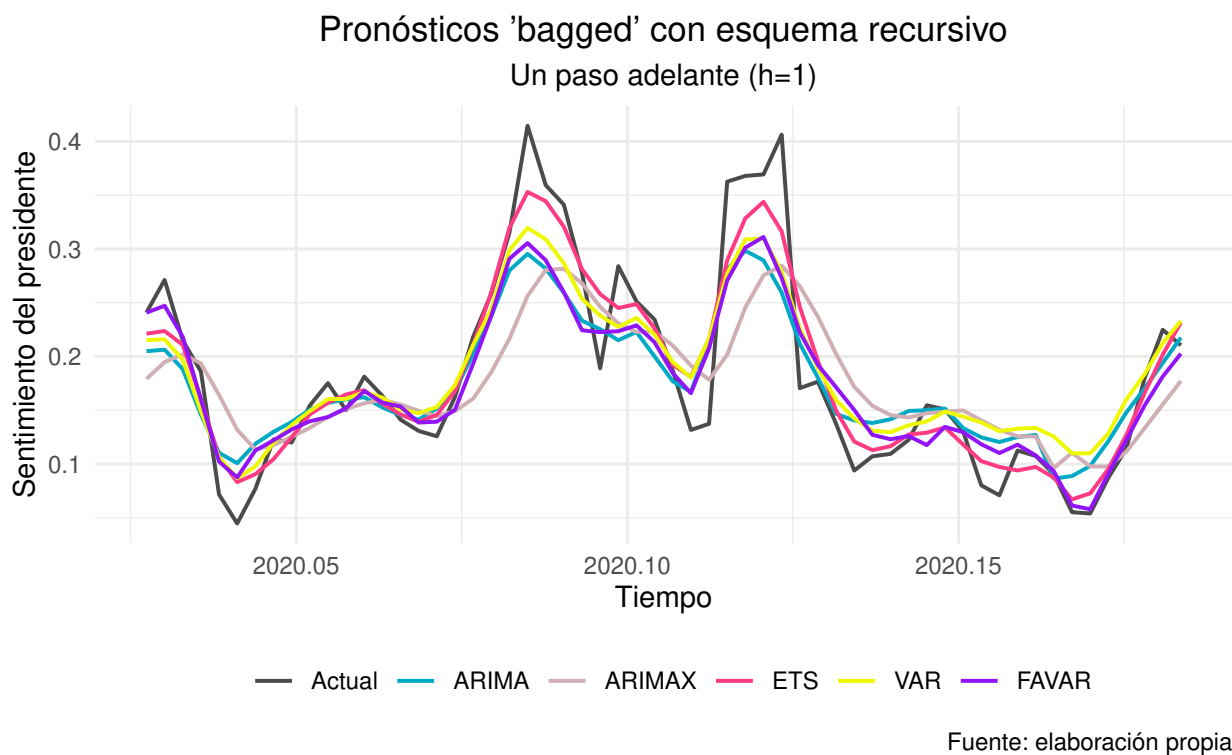


Figura 8: Pronósticos

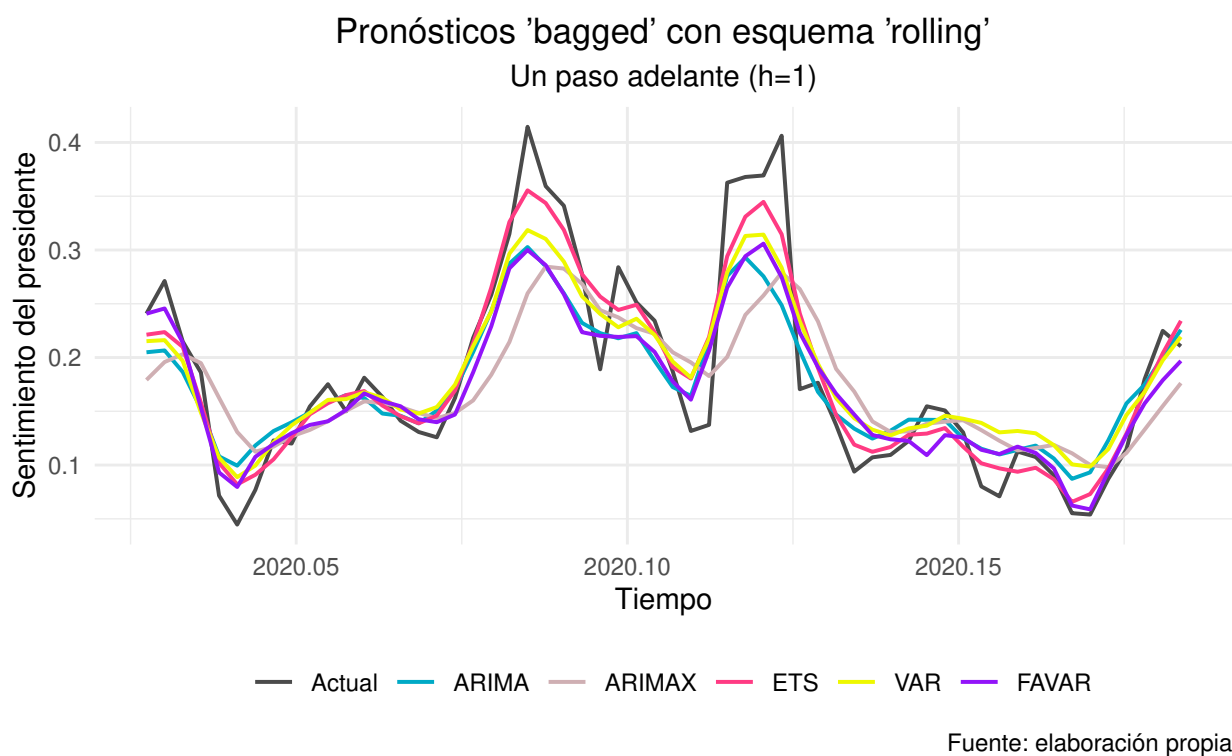
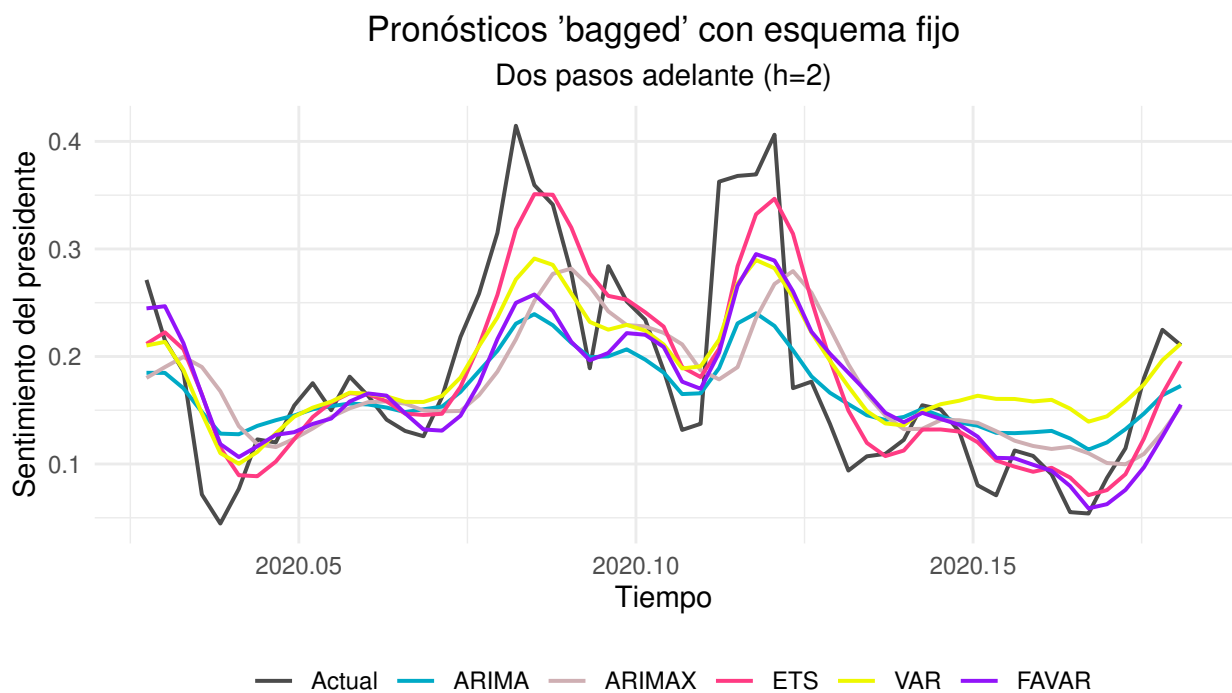
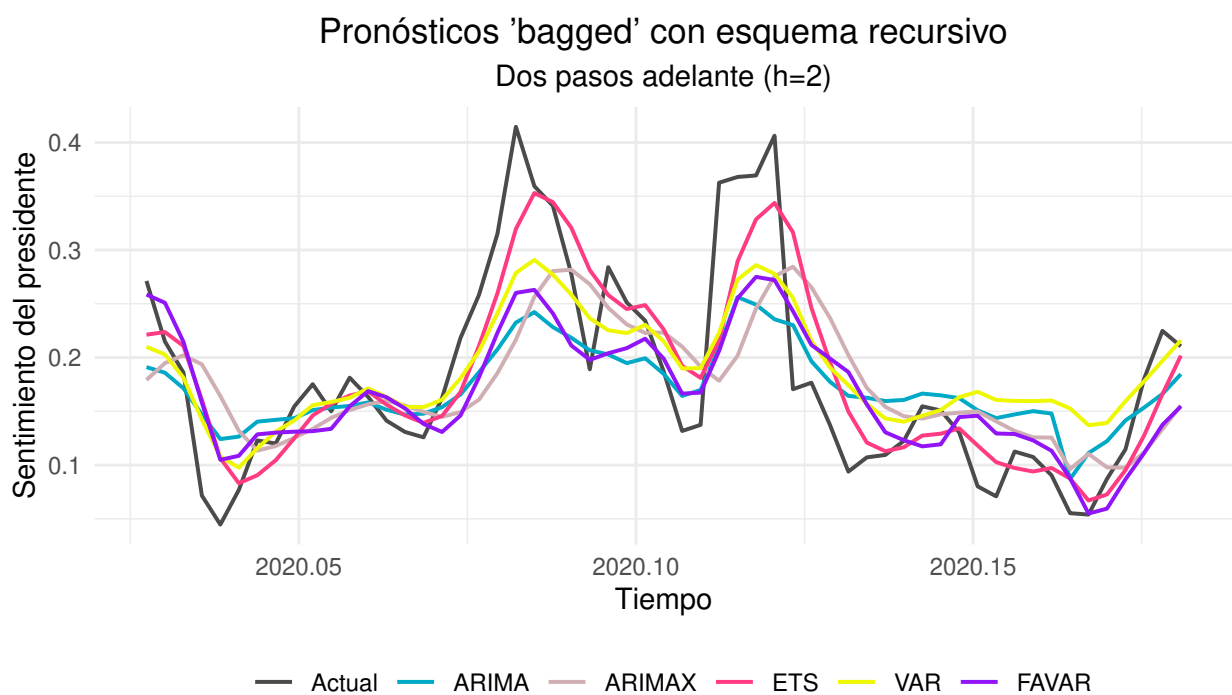


Figura 9: Pronósticos



Fuente: elaboración propia

Figura 10: Pronósticos



Fuente: elaboración propia

Figura 11: Pronósticos

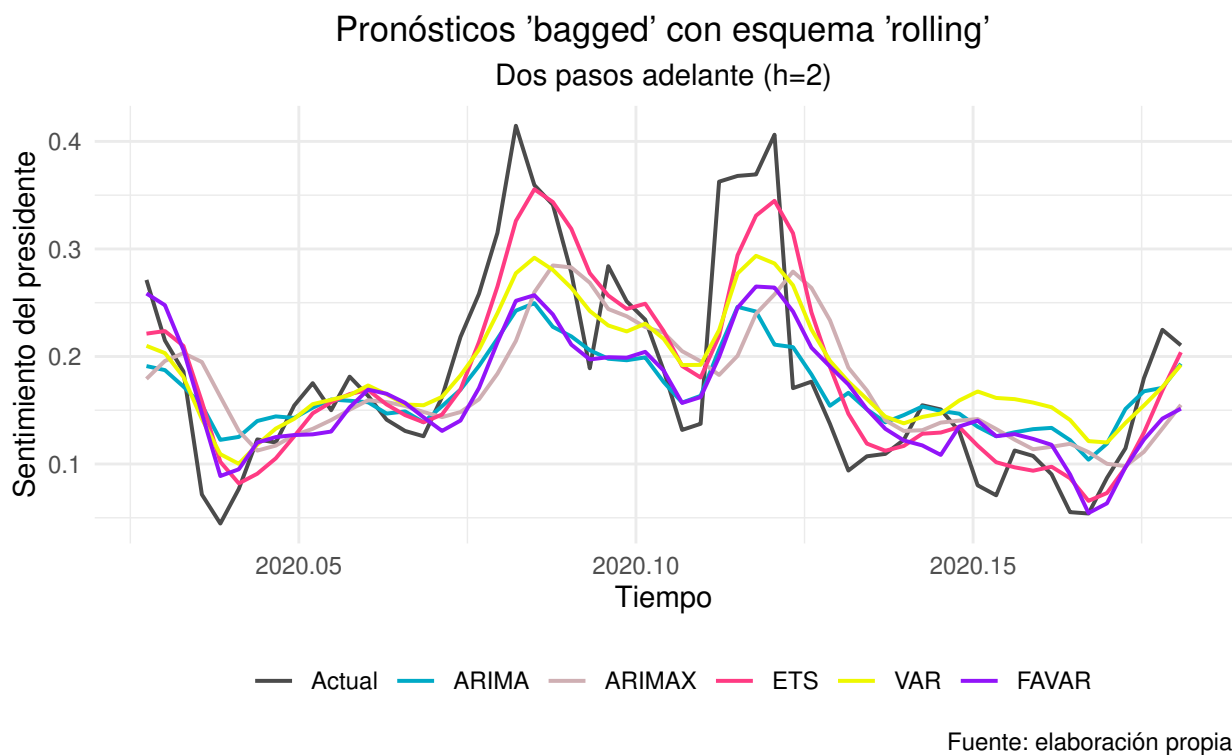


Figura 12: Pronósticos

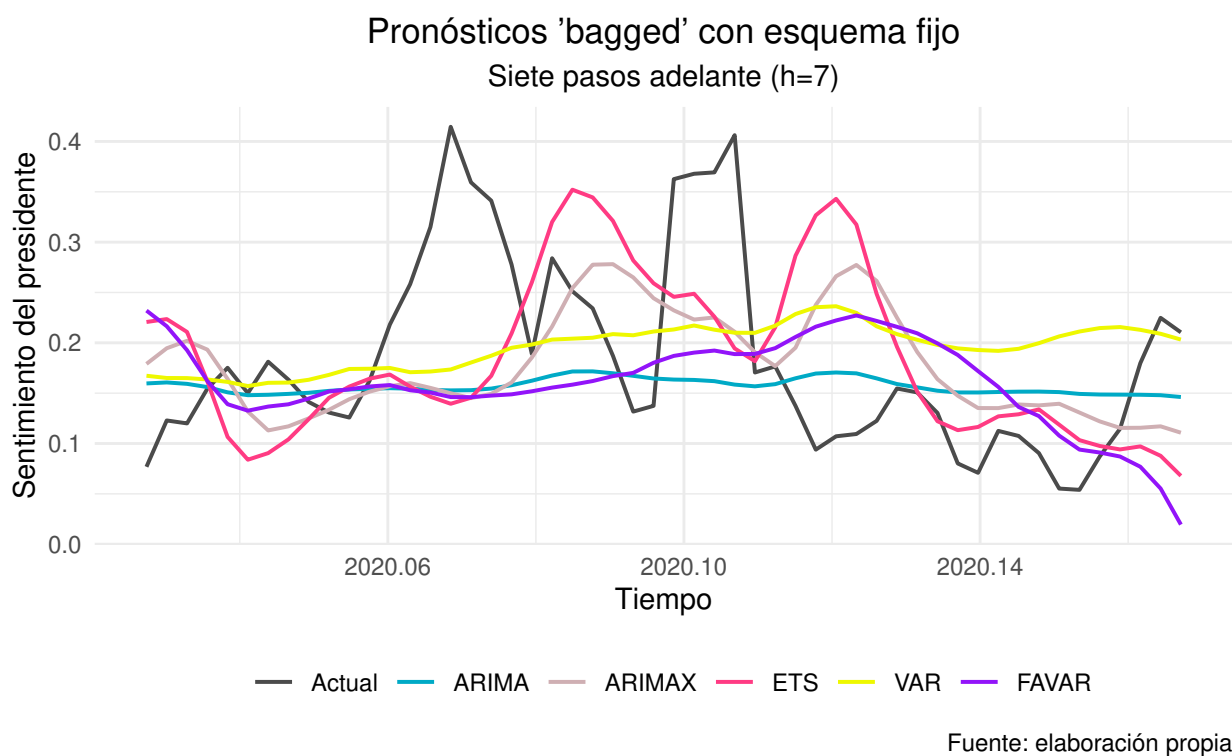


Figura 13: Pronósticos

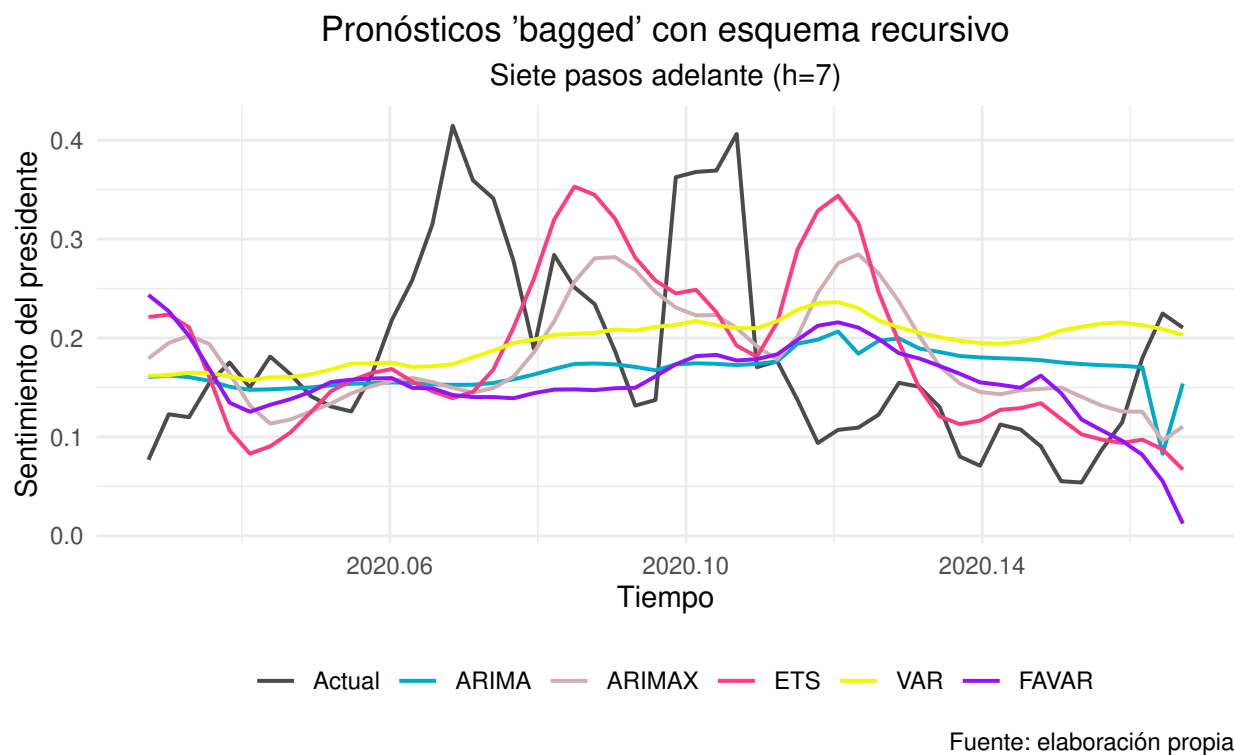


Figura 14: Pronósticos

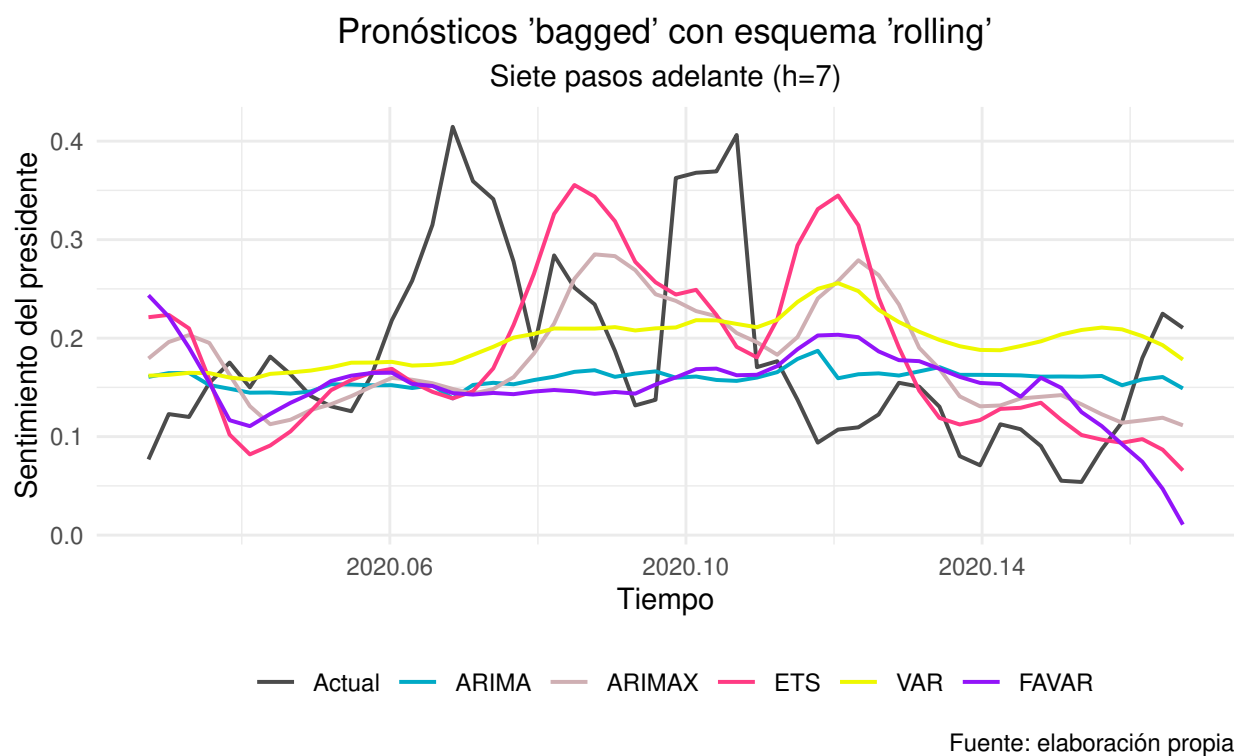
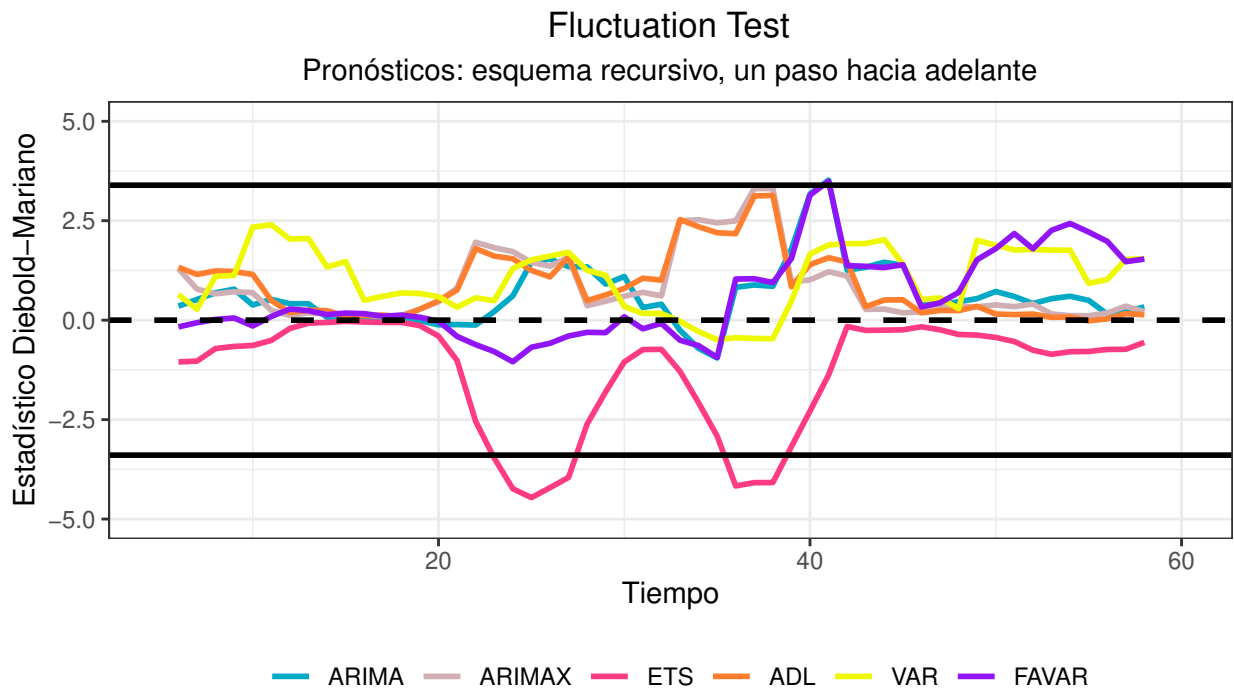


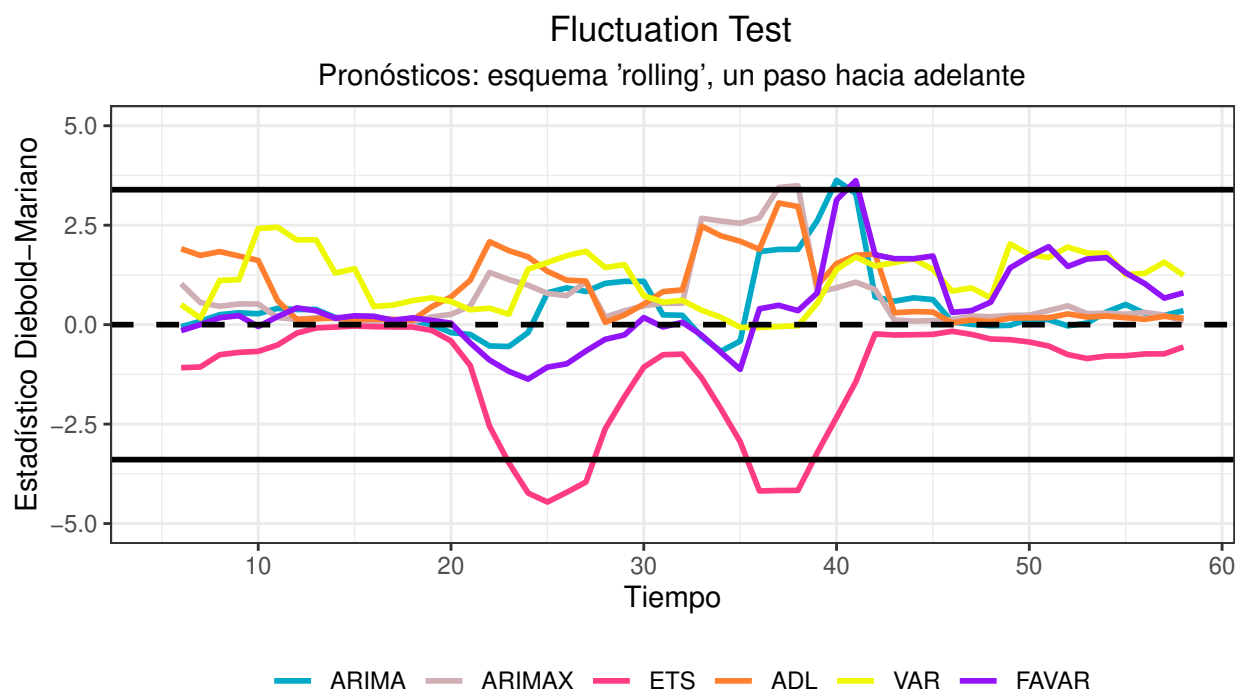
Figura 15: Pronósticos

2. Tests de Giacomini-Rossi



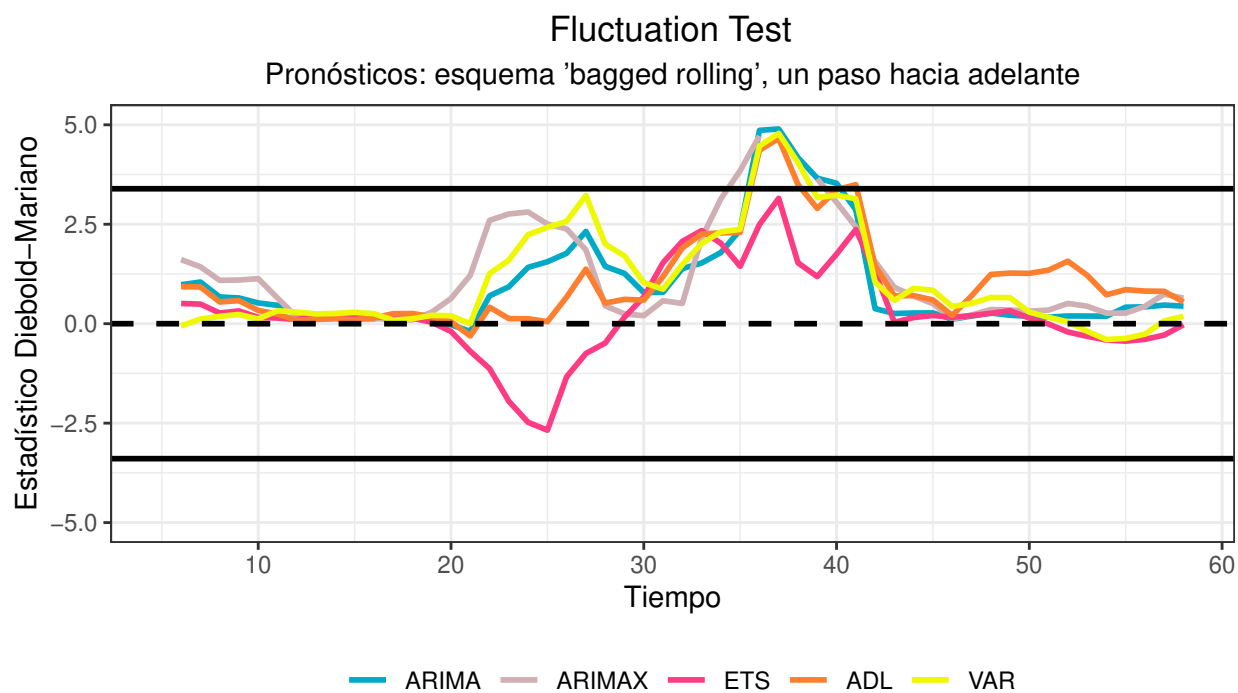
Fuente: elaboración propia

Figura 16: Test de Giacomini Rossi (esquema recursivo, un paso adelante)



Fuente: elaboración propia

Figura 17: Test de Giacomini Rossi (esquema *rolling*, un paso adelante)



Fuente: elaboración propia

Figura 18: Test de Giacomini Rossi (esquema *bagged rolling*, un paso adelante)

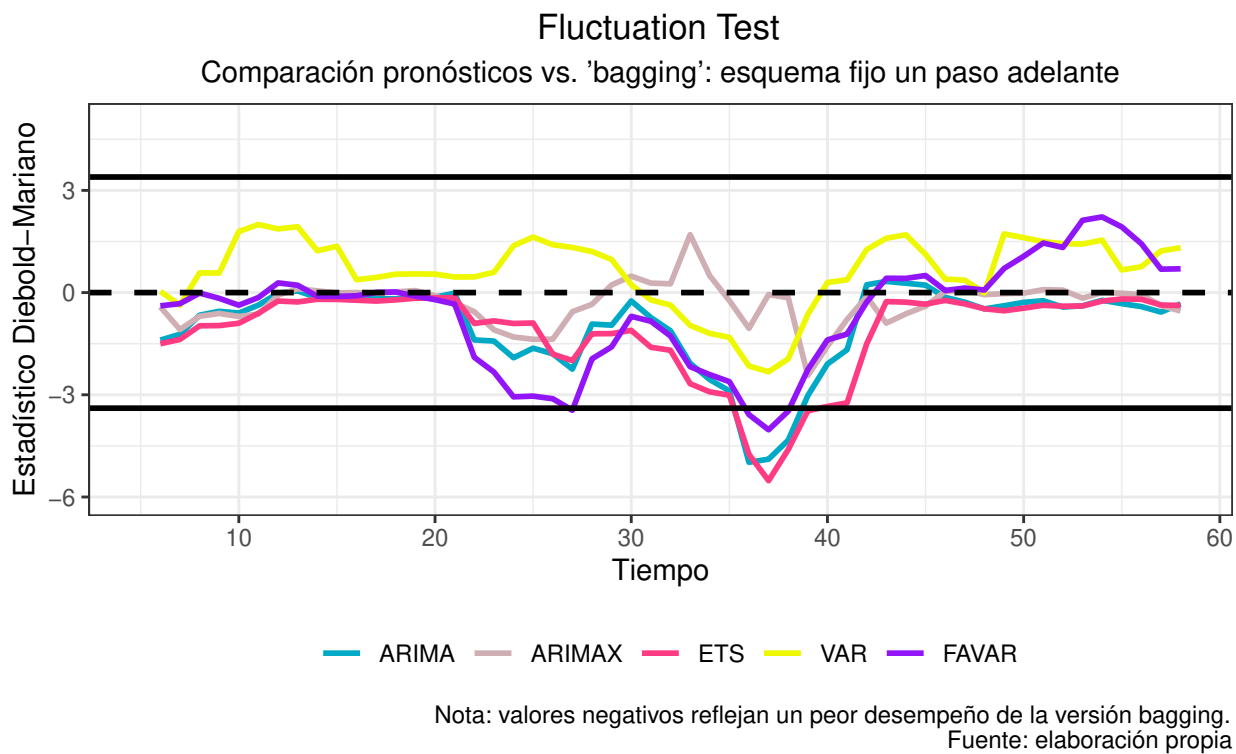


Figura 19: Test de Giacomini Rossi (comparación con modelos *bagged*: esquema fijo un paso adelante)

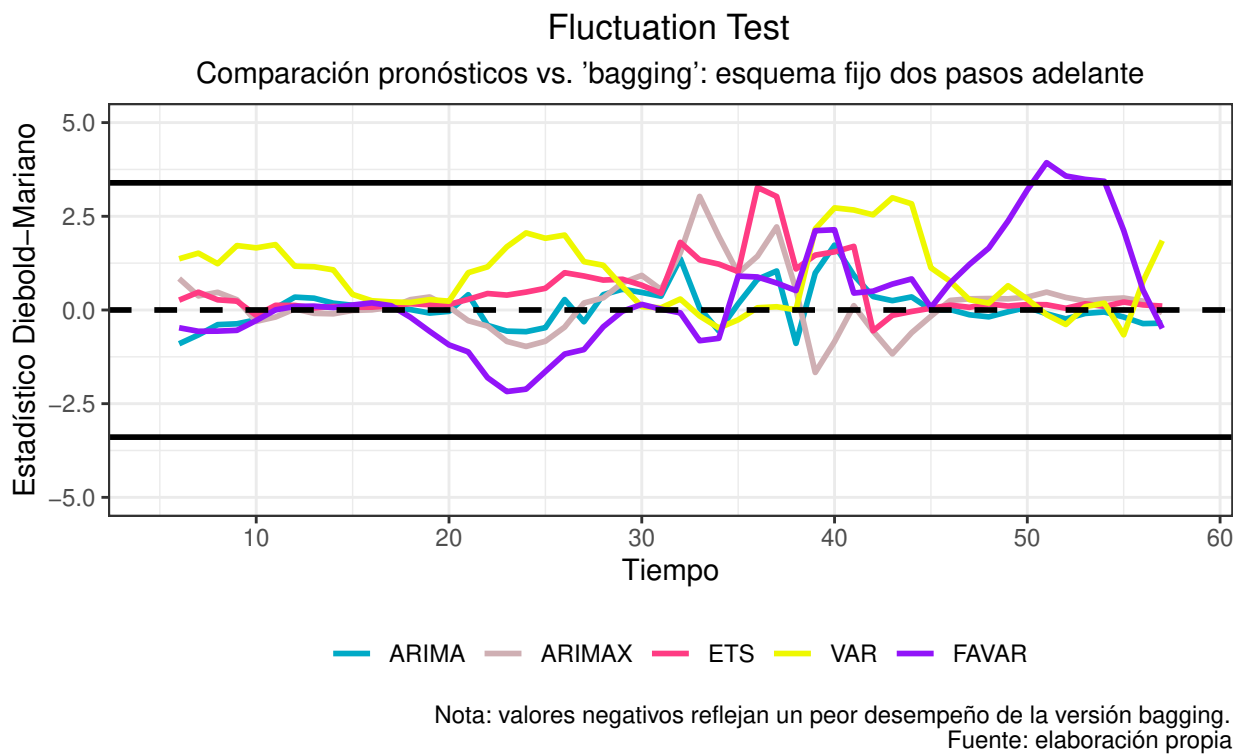


Figura 20: Test de Giacomini Rossi (comparación con modelos *bagged*: esquema fijo dos pasos adelante)

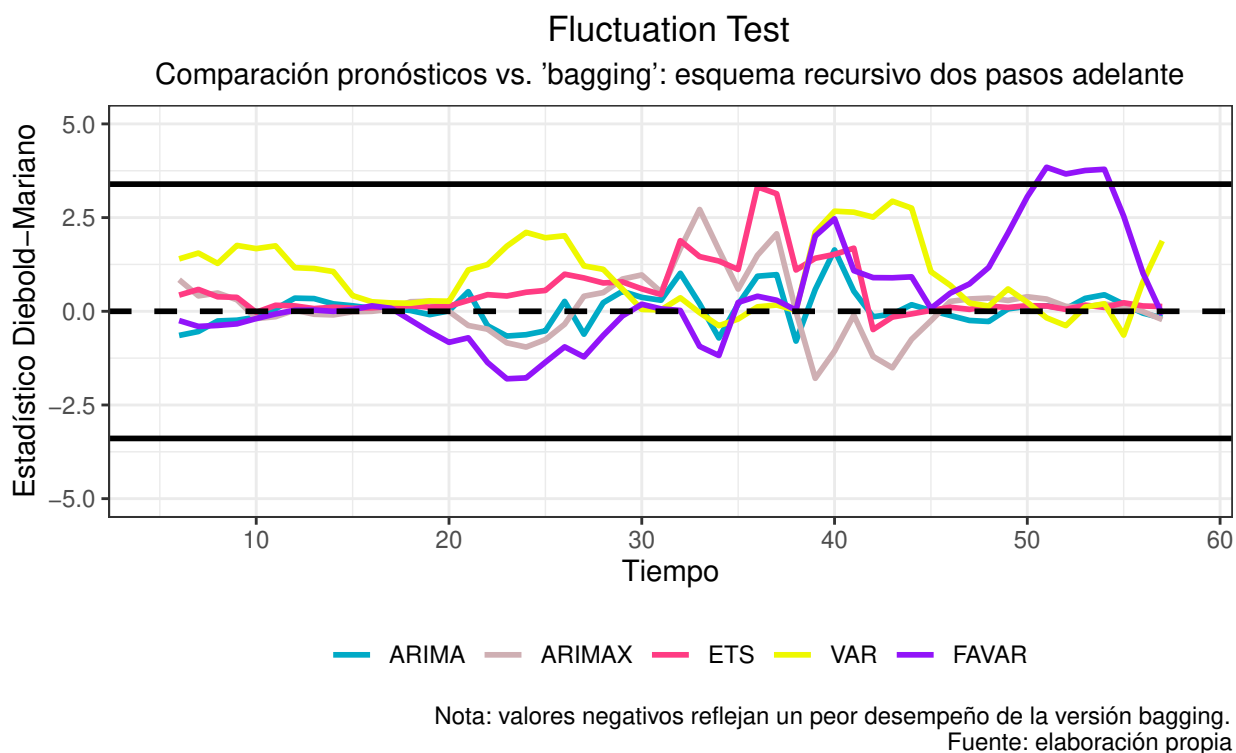


Figura 21: Test de Giacomini Rossi (comparación con modelos *bagged*: esquema recursivo dos pasos adelante)

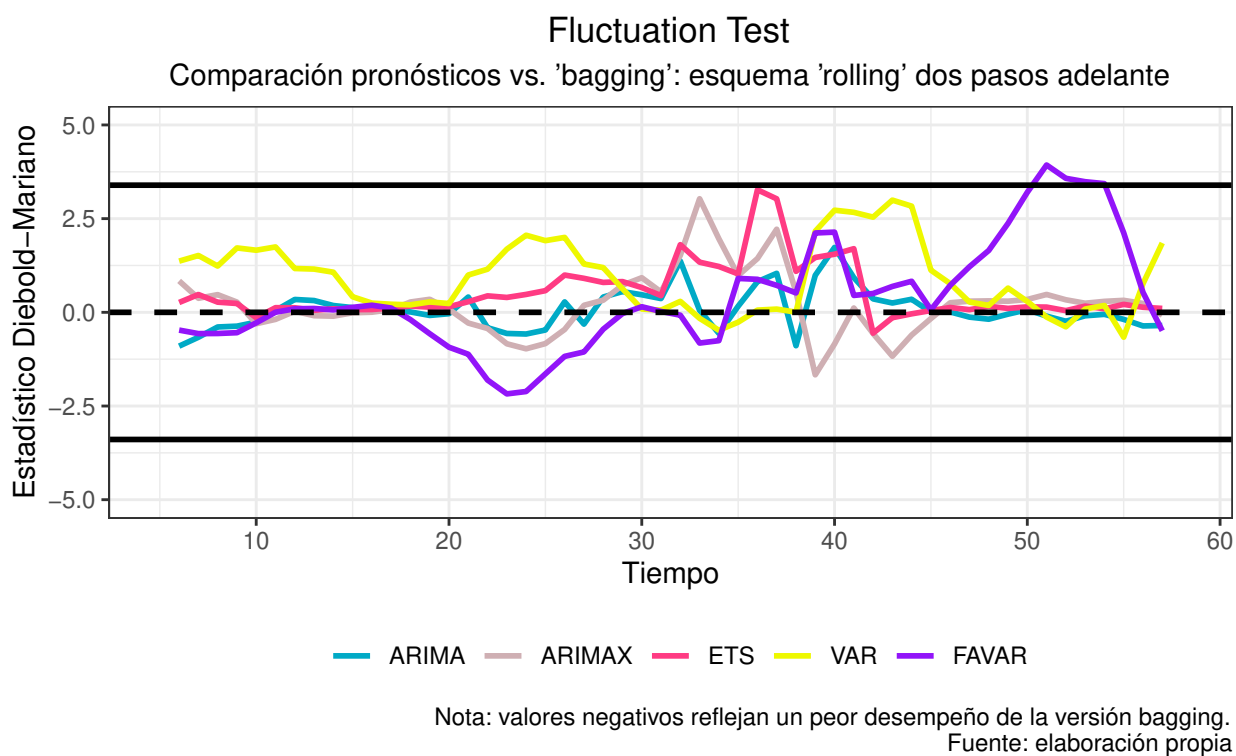
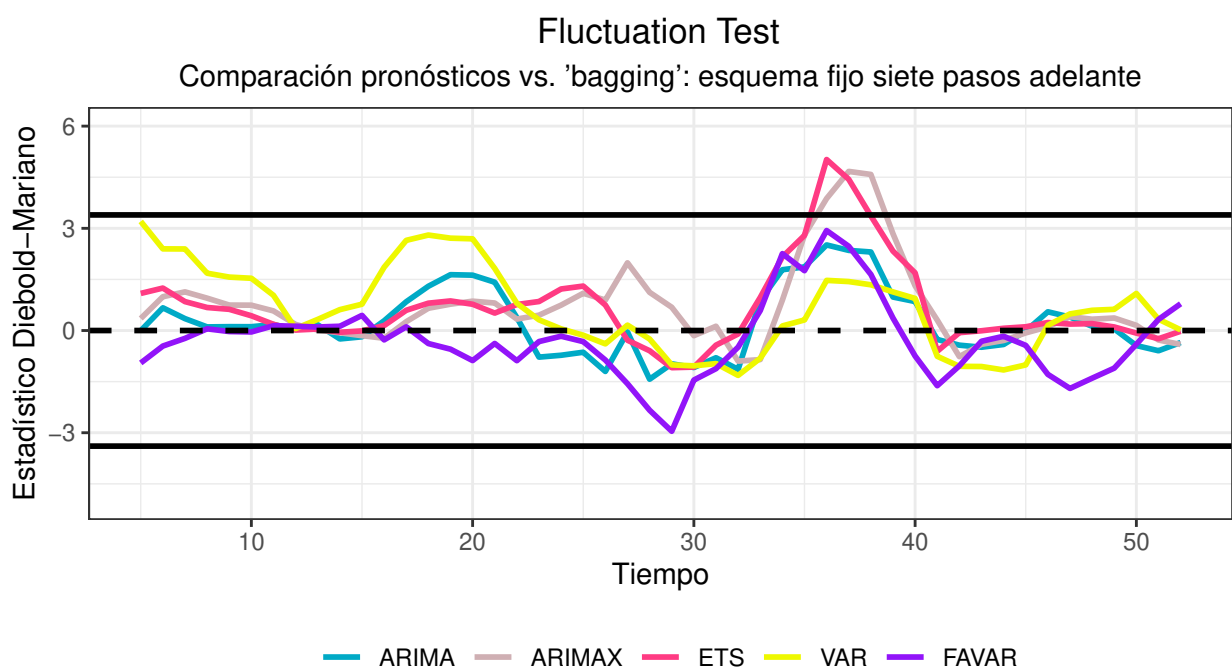


Figura 22: Test de Giacomini Rossi (comparación con modelos *bagged*: esquema *rolling* dos pasos adelante)



Nota: valores negativos reflejan un peor desempeño de la versión bagging.
Fuente: elaboración propia

Figura 23: Test de Giacomini Rossi (comparación con modelos *bagged*: esquema fijo un siete pasos)