
ZADANIE 1: Używając biblioteki quantmod pobierz dane nt. cen akcji wybranej przez siebie spółki, następnie przygotuj je do analizy w pakiecie YUIMA.

ZADANIE 2: Wyestymuj parametry na podstawie przygotowanych danych, jeżeli założymy, że proces X_t modelujący trajektorię spełnia jedno z poniższych równań stochastycznych:

a) $dX_t = \mu X_t dt + \sigma X_t dB_t,$

b) $dX_t = \mu X_t dt + \sigma \sqrt{X_t} dB_t,$

c) $dX_t = (\mu X_t + \gamma) dt + \sigma dB_t.$

Posługując się kryteriami informacyjnymi stwierdź, który z modeli najlepiej opisuje historię cen akcji Twojej firmy.

ZADANIE 3: Używając biblioteki yuimaGUI przeanalizuj jeszcze raz dwa pierwsze zadania.