

IN5303 Finanzas II

TAREA 4

Fecha de Entrega 12 de diciembre de 2011
16 horas Secretaría Docente
Trabajo en Grupos de 3 personas¹

Problema 1)

Usando el precio publicado de una tasa de interés², y un tipo de cambio (**no** usar el tipo de cambio peso dólar) se pide que encuentre estadísticamente los parámetros de los procesos estocásticos que siguen dichas series.

En particular se pide que intente calibrar modelos de la forma

$$dr = \alpha(\beta - r)dt + \gamma dz_1$$
$$d \ln(S) = a(b - \ln(S))dt + \sigma dz_2$$

Donde r es la tasa de interés y S es el tipo de cambio

Se pide:

Utilizando series de tiempo discuta los valores y la significancia estadística de los parámetros en los modelos propuestos, y la bondad de ajuste de los modelos propuestos.

Problema 2)

- Seleccione una serie de precios económica (por ejemplo inflación, desempleo, imacec, exportaciones, importaciones, etc) y ajuste un modelo de series de tiempo para dicha serie. Explique claramente cómo selecciona el modelo final, y realice una proyección de la serie a 6 meses más.
- Repita el ejercicio anterior para el precio de una acción cualquiera. Comente sobre las diferencias que encuentra con respecto del cálculo anterior.

¹ Salvo los expresamente autorizados por el Profesor.

² Sugiero series diarias que son más fáciles de obtener en páginas web internacionales. Alternativamente use tasas disponibles en la ABIF, o bien en el Banco Central de Chile.