



IN5303 Finanzas II

TAREA 3

Fecha Final de Entrega: sábado 12 de mayo de 2012

10 horas Portería del DII

Antes de esa fecha se podrán entregar en Secretaría Docente
Trabajo en Grupos de 3 personas¹

- 1) Seleccione una serie mensual macroeconómica, con excepción de precios (puede ser el IMACEC, desempleo, Exportaciones, etc.) y para ella se pide plantear y estimar un modelo ARMA(p,q). Discuta en particular la lógica económica de sus resultados.
- 2) Seleccione una serie financiera con observaciones diarias, y discuta:
 - a. Ajuste un modelo AR(p) sobre log de la serie, y discuta sus resultados
 - b. Realice un análisis estadístico para verificar si la serie de retornos logarítmicos diarios es un camino aleatorio.
 - c. Repita el ejercicio en b) para observaciones semanales (por ejemplo los días lunes) y mensuales (por ejemplo precios de fin de mes). Compare los resultados obtenidos y comente sus resultados.

¹ Salvo los expresamente autorizados por el Profesor.