

## ESTADÍSTICA APLICADA A LAS FINANZAS – DOPAZZO – FINAL – 5/06/03

- 1) El DT industrial A durante el día revisa las diferentes operaciones que van pasando. Para hacer un análisis se toman registros de diferentes horas d los primeros días del mes de Noviembre y Diciembre.

NOV: 7493, 7525, 7760, 74 99, 7555, 7690, 7668, 7600, 7516, 7700  
DIC: 8066, 8209, 7842, 7943, 7846, 8071, 8055, 8159, 7828, 8109

Nov	Dic
n=10	N=10
$\bar{x}_n = 7601$	$\bar{x}_d = 8012,8$
$S_n = 98,3$	$S_d = 138,7$

Yo tomo  $\alpha = 0,1$

- 2) Se cree que existe asociación lineal paralela entre IPC y el D.J. Se supone que el IPC influye s/DJ. Se analizan 10 meses en distintos años.

X	IPC	13	14,2	13,7	15,1	12,6	13,8	15,7	16	11,3	10,4
y	DJ	660	638	639	597	702	650	579	570	725	738

- a) Hallar recta  $\min^2$  e interpretar estimadores  
b) Investigar asociación lineal. Indicar influencia % del IPC s/ DJ

3) El gobierno desea estudiar la posibilidad de reducir la tasa de desocupación según: “reducir horas de trabajo” (y con  $\downarrow$  paga), para que esas horas sean cubiertas por otros trabajadores. La medida se toma si se puede asegurar que más del 40% están dispuestos a trabajar menos con menos \$. Para esto se realiza un estudio n = 2000 y sólo 1100 está en desacuerdo con la medida.

- a) A la luz de los resultados, con  $\alpha = 1\%$ , ¿se puede asegurar que es factible la implementación?  
b) Para 1 NC 95% estimar % de disconformes con la medida.

4) Se desea adquirir una cartera si se puede asegurar un rendimiento promedio mínimo de 7 US\$ / Acc con rentabilidad mínima 7 US\$ / Acc. De 1 muestra de 12 acciones, elegidas al azar se obtuvo el siguiente rendimiento en US\$:

11,26	9,83	12,56	33,02	19,69	-12,54	-1,31	-5,73	17,4	14,35	1,27	9,99
-------	------	-------	-------	-------	--------	-------	-------	------	-------	------	------

- a) Asumiendo riesgo 5%, ¿parámetro de la cartera igual a lo estipulado?  
b) Estimar rendimiento promedio y  $\Gamma$  de la cartera.  
c) ¿Cuántas acciones más se deben observar para disminuir el error de estimación de rendimiento a la tercera parte?