

Nombre: _____

Examen Final

En el sitio web de la bolsa de valores de Estados Unidos se reporta el valor del Índice S&P 500 y del Índice VIX (el cual mide la volatilidad implícita del S&P 500 durante los próximos 30 días). Utiliza la base de datos proporcionada para determinar:

- 1) La ecuación que explica el comportamiento del S&P 500 en función del VIX.

$$S\&P500=2046.5+(-27.88)*VIX$$

- 2) Calcula R^2 .

40.62%

- 3) Desarrolle la prueba de hipótesis para la pendiente y concluye si este método es significativo para explicar la relación entre estas variables.

F	Pvalue
686.6769	0.000

Se rechaza la nula de que la pendiente es igual a cero por lo que si es significativo.

- 4) El intervalo de confianza del 92% para el coeficiente de la pendiente.

Superior	-26.01
Inferior	-29.74

- 5) Estime el valor de S&P500 cuando el VIX es igual a 20.30.

VIX	20.3
S&P500	1480.63