Progetto: ANALISI DELLE SERIE STORICHE

Sulle serie storiche giornaliere fornite stimare modelli GARCH con differenti distribuzioni (Normale, T-Student, Skew Normal, Skew t, GED ) usare la routine di R rugarch. Calcolare per ogni modello stimato il Value at Risk. Effettuare la scelta del modello sulla base della procedura di backtesting.

Project: TIME SERIES AND FINANCIAL TIME SERIES

On the daily time series provided, estimate GARCH models with different distributions (Normal, T-Student, Skew Normal, Skew t, GED) use the R rugarch routine. Calculate the VaR for each model estimated. Choose the best model based on the backtesting procedure.