

# **Anomalía por COVID-19 en el análisis de correlaciones de estados de mercado**

*Wednesday 13 December 2023 11:20 (20 minutes)*

Analizando los estados de mercado de las componentes de los índices S&P500 y EuroSTOXX600, en un horizonte temporal comprendido entre 2006 y 2023, encontramos la aparición de un nuevo estado de mercado no visto anteriormente. Discutiremos sus posibles implicaciones como estado aislado, o como inicio de una nueva condición general de mercado, en términos de la matriz de correlaciones de Pearson y de la correlación relativa con respecto a las series de tiempo del índice. En ambos casos la anomalía se manifiesta fuertemente.

## **Resumen de la contribución**

**Author:** MARTÍNEZ RAMOS, Manuel Mijaíl (ICF, UNAM)

**Presenter:** MARTÍNEZ RAMOS, Manuel Mijaíl (ICF, UNAM)

**Session Classification:** Contribuciones Orales