

Matrices de Disimilaridad: Análisis en el Espacio de Matrices de Correlación del FTSE 100, SBF 120 y HDAX 100

En este trabajo se analizan las correlaciones de series de tiempo cortas, de las fluctuaciones de precios de acciones representativas de los principales mercados de valores de Inglaterra, Francia y Alemania, tomando como referencia las compañías componentes de los índices FTSE 100, SBF 120 y HDAX 100, respectivamente. El análisis de las estructuras de correlación se acota al lapso del 3 de enero de 2006 al 10 de agosto de 2023. Se obtiene una representación gráfica de la similaridad entre los tres mercados financieros, dando un punto de partida intuitivo para estudiar y comparar su dinámica. Área de investigación: Fenómenos No Lineales, Econofísica, Finanzas.

Resumen de la contribución

Author: HERNÁNDEZ MARTÍNEZ, Vladimir (ICF, UNAM)

Presenter: HERNÁNDEZ MARTÍNEZ, Vladimir (ICF, UNAM)