Tabla Nº. 11. Estimación de efectos ARCH

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| Método:  **MCO** | Variable dependiente: rtcp | Muestra: 04/01/2005 – 01/01/2016 |
| **Variable** | **Coeficiente** | **ee** | **t- estadístico** | **Prob.** |
| C | 0,086683 | 0,016194 | 5,352922 | 0,0000 |
| MA(1) | -0,075088 | 0,018627 | -4,031209 | 0,0001 |
| **R2:** 0,005122 | **JarqueBera(Residuos):** 141872,3 | **Prob(JB):** 0,0000 |
|  | **Rezago** | **Estadístico Q** | **Prob. (Q)** |
| **Autocorrelación de residuos** | 10 | 49,178 | 0,000 |
| **Autocorrelación de residuos^2** | 10 | 320,50 | 0,000 |
|  | **Rezago** | **Estadístico *X2*** | **Prob. ( *X2*)** |
| **Efectos ARCH** | 1 | 261,1925 | 0,0000 |
| **Efectos ARCH** | 10 | 46,39190 | 0,0000 |

 **Fuente:** elaboración propia. Datos dólar Cúcuta. $α=5\%$. Prob: probabilidad. Q: estadístico Ljung- Box.