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. . Prob: probabilidad. Q: estadístico Ljung- Box.