

Trabajo final de Análisis de Riesgo y Portafolios de Inversión

Elaborar un portafolio de renta variable y de seis activos teniendo en cuenta lo siguiente:

1. Elegir 6 activos por algún criterio (perfil de inversionista, rendimiento, y/o análisis de correlación) para construir un portafolio.
2. La información se conseguirá de la BMV (o fuentes que la refieran).
3. Considerar 2 escenarios para los intervalos de confianza, un monto a invertir de 10 millones de pesos y un plazo igual al de las observaciones.
4. Hacer análisis estadístico, de volatilidad y VaR por activo y para el portafolio propuesto.
5. Completar el análisis con tablas y gráficos cuando se considere oportuno.
6. Extensión máxima 10 páginas.
7. Si el ejercicio es copiado o plagiado no se tomará en cuenta para evaluación.
8. La entrega es para el 8 de diciembre de 2017.