

Trabajo final de Análisis de Riesgo y Portafolios de Inversión

Elaborar un portafolio de cinco activos teniendo en cuenta lo siguiente:

1. Los precios de los 58 activos están en negritas en 58 pestañas de la hoja de cálculo
2. Elegir 5 activos por algún criterio (perfil de inversionista y/o análisis de correlación) para construir un portafolio
3. Considerar 2 escenarios para los intervalos de confianza, un monto a invertir de 2 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