

¿Cuál es la mejor forma de obtener mayores rendimientos en los mercados bursátiles de una forma segura?

(PROBLEMAS)

- Supuestos de normalidad de los retornos
- Los efectos de patrones no lineales
- Factores externos que impacten el mercado

Metodología de reducción de dimensionalidad usando ACP

Uso de cadenas de Markov de primer o segundo orden

La decisión se basa en los vectores de probabilidad estacionarios de las cadenas de Markov