

## **Título del Trabajo: Simulación de Portfolios de Inversión Considerando el Índice de Volatilidad (VIX)**

**Objeto del estudio:** El objetivo principal de este trabajo es realizar una simulación de portfolios de inversión, considerando el Índice de Volatilidad (VIX) como un factor clave en la toma de decisiones. Se busca analizar la relación entre el VIX y la volatilidad de activos financieros, así como diseñar estrategias de inversión dinámicas que se ajusten a los cambios en la percepción del riesgo.

### **Índice Aproximado:**

1. **Introducción**
  - Contextualización y relevancia del estudio.
2. **Análisis de la Relación VIX-Volatilidad**
  - Exploración de datos históricos y análisis estadístico.
3. **Simulación de Escenarios**
  - Implementación de técnicas de simulación basadas en fórmulas recursivas.
4. **Construcción de Portfolios Dinámicos**
  - Diseño de estrategias de inversión que consideren la evolución del VIX.
5. **Evaluación de Rendimiento**
  - Comparación de rendimiento de portfolios bajo diferentes condiciones de volatilidad.
6. **Conclusiones y Recomendaciones**
  - Síntesis de resultados y posibles líneas de investigación futura.

**Descripción y Justificación de la Técnica o Técnicas Utilizadas:** La elección de la simulación se justifica por su capacidad para modelar escenarios complejos y dinámicos, permitiendo evaluar el impacto de la volatilidad en los portafolios de inversión. Se utilizarán técnicas de simulación basadas en fórmulas recursivas para capturar la variabilidad del VIX y su influencia en la toma de decisiones de inversión.

### **Bibliografía Mínima:**

- ISBN(13):9788436277203 Título:GESTIÓN DE RIESGO DE MERCADO. MÉTODOS AVANZADOS PARA SU CUANTIFICACIÓN Y CONTROL Autor/es:Benito Muela, Sonia ; López Martín, Carmen ; García Jorcano, Laura ; Arguedas Sanz, Raquel ; Editorial:UNED
- Predicción y simulación aplicada a la economía y gestión de empresas Editorial: Pirámide Fecha: 1999 Autor: Antonio Pulido / Ana López

Agradezco de antemano su consideración y quedo a disposición para cualquier aclaración o sugerencia que consideren pertinente.

