

Objetivo de la práctica de sesión 3 y 4

A partir de una serie de datos históricos de precios de varios activos, vamos a realizar los siguientes ejercicios

1. Calcular su frontera eficiente usando el modelo de Media Varianza.
2. Para un horizonte temporal construiremos una cartera con esos activos hallando
 - a. Rentabilidad histórica de la cartera con esos pesos.
 - b. Calculo de riesgos: volatilidad, VaR, contribución de riesgo
 - c. Simulación de cambios en la cartera y ver sus variaciones.
 - d. Construcción de la cartera según método tradicional o risk parity.
3. Construcción de carteras Beta Neutral
 - a. Para una cartera de renta variable, usar técnicas para neutralizar su beta a partir de métodos de gestión alternativa como “portable alpha”.