

Comprobación de Conceptos Semana VII

R con Enfoque Financiero: AulaABA

Selecciona la opción correcta para cada una de las siguientes preguntas.

1. ¿Cuál es el paquete en R que se utiliza para realizar análisis de carteras de inversión?
 - ☐ `dplyr`
 - ☐ `tidyverse`
 - ☐ `ggplot2`
 - ☐ `PortfolioAnalytics`
2. ¿Qué función se utiliza en `PortfolioAnalytics` para crear un objeto de cartera?
 - ☐ `create_portfolio()`
 - ☐ `build_portfolio()`
 - ☐ `portfolio_object()`
 - ☐ `new_portfolio()`
3. ¿Cómo se añaden activos a una cartera en `PortfolioAnalytics`?
 - ☐ Utilizando la función `add_asset()`
 - ☐ Utilizando la función `add_security()`
 - ☐ Utilizando la función `add_instrument()`
 - ☐ Utilizando la función `add_ticker()`
4. ¿Cuál es la función en `PortfolioAnalytics` para calcular las estadísticas de rendimiento de una cartera?
 - ☐ `portfolio_stats()`
 - ☐ `calculate_performance()`
 - ☐ `portfolio_performance()`
 - ☐ `calculate_stats()`
5. ¿Qué función se utiliza en `PortfolioAnalytics` para calcular el rendimiento histórico de una cartera?
 - ☐ `portfolio_returns()`
 - ☐ `calculate_returns()`
 - ☐ `portfolio_performance()`
 - ☐ `calculate_performance()`
6. ¿Cuál es la función en `PortfolioAnalytics` para calcular la volatilidad de una cartera?
 - ☐ `portfolio_volatility()`
 - ☐ `calculate_volatility()`
 - ☐ `portfolio_risk()`
 - ☐ `calculate_risk()`
7. ¿Cómo se optimiza una cartera en `PortfolioAnalytics` para encontrar la asignación de activos óptima?
 - ☐ Utilizando la función `optimize_portfolio()`
 - ☐ Utilizando la función `optimize_allocation()`
 - ☐ Utilizando la función `portfolio_optimize()`
 - ☐ Utilizando la función `portfolio_allocation()`
8. ¿Cuál es la función en `PortfolioAnalytics` para realizar una simulación de montecarlo de una cartera?

- ☐ `portfolio_monte_carlo()`
- ☐ `simulate_monte_carlo()`
- ☐ `portfolio_simulation()`
- ☐ `simulate_portfolio()`

9. ¿Qué función se utiliza en PortfolioAnalytics para realizar un análisis de riesgo de cola (tail risk) de una cartera?

- ☐ `portfolio_tail_risk()`
- ☐ `analyze_tail_risk()`
- ☐ `calculate_tail_risk()`
- ☐ `tail_risk_portfolio()`

10. ¿Cómo se realiza una rebalanceo de una cartera en PortfolioAnalytics?

- ☐ Utilizando la función `rebalance_portfolio()`
- ☐ Utilizando la función `reallocate_portfolio()`
- ☐ Utilizando la función `portfolio_rebalance()`
- ☐ Utilizando la función `portfolio_reallocation()`

Respuestas

PortfolioAnalytics `create_portfolio()` Utilizando la función `add_asset()` `portfolio_stats()` `portfolio_returns()` `portfolio_volatility()` Utilizando la función `optimize_portfolio()` `portfolio_monte_carlo()` `portfolio_tail_risk()` Utilizando la función `rebalance_portfolio()`