ANALISIS BURSÁTIL: ANÁLISIS DE RENDIMIENTOS Y OPTIMIZACIÓN DE UNA CARTERA EN R

Ivan Weyner – Cristian Soto – Federico von Brudersdorff.

Diciembre 2019.

Universidad de Buenos Aires.

Facultad de Ciencias Económicas.

Computación Científica Actuarial

**Abstract**

Este es un documento de Word de ejemplo que puede ser usado como plantilla para dar formato a su tesis o disertación. El abstract o resumen debe contar con **350 palabras o menos**.

**Tabla de Contenidos**

[Capítulo 1 Introducción e información general 1](#_Toc410628920)

[Título 2 1](#_Toc410628921)

[Título 2 1](#_Toc410628922)

[Título 3. 1](#_Toc410628923)

[Título 3. 1](#_Toc410628924)

[Capítulo 2 Figuras y tablas 2](#_Toc410628925)

[Título 2 2](#_Toc410628926)

[Título 3. 2](#_Toc410628927)

[Título 3. 2](#_Toc410628928)

[Capítulo 4 Resultados y discussion. 5](#_Toc410628929)

[List of References 6](#_Toc410628930)

[Apéndice 7](#_Toc410628931)

[Vita 8](#_Toc410628932)

# Parte 1 Introducción y Marco Teórico

## Planteamiento

Los mercados bursátiles continúan adquiriendo relevancia en la economía global. Existen diversas herramientas, cada vez más accesibles que permiten un fácil de variables, al menos, interesantes de un activo financiero.

Existen diversas teorías que plantean distintas variables a observar para intentar entender el movimiento en los precios de un activo y las implicancias de estos movimientos.

Este trabajo utiliza como sustento teórico la visión de la teoría del portafolio de Markowitz, que requiere contar con un subrogante cuantitativo del riesgo y este es asociado a la distribución de probabilidad de los rendimientos.

En la actualidad este tipo de análisis es fácil de realizar mediante diversos paquetes

## Objetivo

Mediante los diversos paquetes existentes en el lenguaje de programación R es posible analizar diversas variables de interés para el programador sobre un activo financiero.

### Título 3.

El uso de estilos es de ayuda a la hora de generar una tabla de contenidos. Este documento de ejemplo usa los títulos, subtítulos y demás estilos para generar automáticamente la tabla de contenido, lista de tablas y lista de figuras. Este documento está configurado para seguir las normas APA.

### Título 3.

Acá puede ir otra idea del documento.

# 

# Análisis de Resultados

## Obtención de datos

Mediante el uso del paquete tidyquant es posible acceder a una amplia variedad de funciones utilizadas en las finanzas cuantitativas. Entre ellas se encuentra *tq\_get* que permite acceder a la información de cualquier activo que se encuentre en Yahoo Finance, esta función se configura para recibir la serie de tiempo de los precios de un activo indicado, requiere que se le indique el comienzo y el fin de esta, es por eso que el script utiliza las variables fecha.comienzo y fecha.fin para unificar la información que se solicitará de distintos activos.

Se busca información de los siguientes índices: Merval(Argentina), S&P 500(EE UU), Nikkei(Japón), Shangai(China) y Sensex(India), esta selección no tiene ninguna particularidad a priori.

Este trabajo utiliza como sustento teórico la visión de la teoría del portafolio de Markowitz, que requiere contar con un subrogante cuantitativo del riesgo y este es asociado a la distribución de probabilidad de los rendimientos.

En la actualidad este tipo de análisis es fácil de realizar mediante diversos paquetes

## Objetivo

Mediante los diversos paquetes existentes en el lenguaje de programación R es posible analizar diversas variables de interés para el programador sobre un activo financiero.

### Título 3.

# El uso de estilos es de ayuda a la hora de generar una tabla de contenidos. Este documento de ejemplo usa los títulos, subtítulos y demás estilos para generar

# Análisis de Resultados Obtención de Datos

Las tablas y figuras junto con el texto deben ser puestos en la misma página donde son mencionados por primera vez en el texto. Las tablas y figuras grandes deben ser agregadas en una página separada. La tabla 1 es más grande que media página y por lo tanto fue agregada en una página para sí misma. La página antes de la figura debe ser una página llena de texto a menos que esta esté al final del capítulo. Esto aplica incluso si un párrafo debe ser dividido en varias páginas.

## Título 2

Tablas y figuras deben ser puestas en páginas diferentes independientemente de su tamaño. No se debe dejar espacios en blanco en las páginas de texto, pero es posible dejar espacio en blanco en páginas que solo contienen tablas y figuras.

### Título 3.

Tablas y figuras pueden ser puestas en un apéndice al final de la tesis o disertación. Si se hace esto se debe estar seguro de indicar que las tablas y figuras están ubicadas en el apéndice. Esto puede ser a través de paréntesis o con pies de página. Es posible poner todas o solo algunas de las tablas y figuras en el apéndice, si todas las tablas y figuras son puestas en el apéndice se debe indicar que “Todas las tablas y figuras están ubicadas en el apéndice” después de la primera mención de una tabla o figuras..

### Título 3.

Los títulos de las tablas deben ser puestos sobre las mimas. En el caso de las figuras deben ser puestos debajo. Todas las tablas deben contar con mínimo 2 columnas y una fila de títulos. Las tablas deben contar a menos con 3 líneas divisorias.

Tabla 1. El título debe ser breve y descriptivo.

|  |  |
| --- | --- |
| ***Column One*** | ***Column Two*** |
| Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data | Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data  Table data |

Estas líneas son la línea incluida en la parte superior de la tabla, la línea entre el la cabecera de la tabla y el contenido y la línea debajo de la tabla.

#### Título 4.

#### Las figuras pueden estar blanco y negro o a color. Si se usa color se debe asegurar que la figura tenga sentido si se imprime a blanco y negro.En la figura 1 se muestran algunas formas.

Figura 1. Formas y descripción de las formas.

# Capítulo 4 Resultados y discusión.

Más texto.

# Lista de referencias

Andrews, S. Fastqc, (2010). A quality control tool for high throughput sequence data.

Augen, J. (2004). Bioinformatics in the post-genomic era: Genome, transcriptome, proteome, and information-based medicine. Addison-Wesley Professional.

Blankenberg, D., Kuster, G. V., Coraor, N., Ananda, G., Lazarus, R., Mangan, M., ... & Taylor, J. (2010). Galaxy: a web‐based genome analysis tool for experimentalists. Current protocols in molecular biology, 19-10.

Bolger, A., & Giorgi, F. Trimmomatic: A Flexible Read Trimming Tool for Illumina NGS Data. URL http://www. usadellab. org/cms/index. php.

Giardine, B., Riemer, C., Hardison, R. C., Burhans, R., Elnitski, L., Shah, P., ... & Nekrutenko, A. (2005). Galaxy: a platform for interactive large-scale genome analysis. Genome research, 15(10), 1451-1455.

# Apéndice

Las tablas y figuras pueden ir en el apéndice como se mencionó anteriormente. También es posible usar el apéndice para incluir datos en bruto, instrumentos de investigación y material adicional.

# Vita

Acá se incluye una breve biografía del autor de la tesis.