

Análisis de Nuevos Enfoques en la Optimización de Portafolios

Javier Horacio Pérez Ricárdez

Octubre del 2024

Elementos Clave de la Metodología PRISMA

A continuación se detallan los elementos clave de la metodología PRISMA presentes en el artículo:

Proceso de selección:

- ▶ El artículo describe el proceso de selección de artículos, incluyendo el uso de filtros para refinar la búsqueda y la selección final de 41 estudios únicos.
- ▶ Se excluyeron los artículos duplicados y aquellos que no cumplían con los criterios de inclusión.

Criterios de elegibilidad:

- ▶ Artículos publicados en revistas entre 2014 y 2018.
- ▶ Artículos en inglés.
- ▶ Artículos que abordan el tema de optimización de portafolios y su relevancia para las preguntas de investigación.

Preguntas de investigación:

- ▶ “¿Cuáles son los métodos, herramientas o técnicas clave que se utilizan en la optimización de portafolios?”
- ▶ “¿Cuáles son las restricciones realistas que se utilizan?”
- ▶ “¿Qué tipo de análisis se realiza con respecto a las acciones: fundamental, técnico o mixto (fundamental y técnico)?”
- ▶ “¿Qué software/lenguaje de programación se utiliza?”

Estrategia de búsqueda:

- ▶ El artículo describe las bases de datos utilizadas (Web of Science) y los términos de búsqueda empleados.
- ▶ Se combinaron diferentes conjuntos de palabras clave para encontrar la mayor cantidad de publicaciones académicas y científicas relevantes.

Extracción de datos:

- ▶ El artículo presenta los datos extraídos de los estudios seleccionados en las Tablas 3, 4 y 5. Esta información incluye:
 - ▶ Métodos exactos y heurísticos utilizados para resolver el problema de optimización de portafolios.
 - ▶ Restricciones realistas consideradas en los modelos.
 - ▶ Tipo de análisis de acciones utilizado (fundamental, técnico o mixto).
 - ▶ Software/lenguaje de programación empleado para la implementación.

Síntesis de resultados:

- ▶ El artículo analiza los resultados de la revisión sistemática en la sección “4. Discussion”.
- ▶ Se discuten las tendencias en la investigación sobre optimización de portafolios, como la creciente popularidad de las técnicas heurísticas, la importancia de la optimización robusta y la incorporación de restricciones realistas.

El Artículo y la Metodología PRISMA

El artículo “Analysis of New Approaches Used in Portfolio Optimization: A Systematic” sí sigue la metodología PRISMA.

En la sección “2. Research method”, los autores mencionan que el estudio se clasifica como una revisión configurativa y que los pasos de la Revisión Sistemática de la Literatura (RSL) se basaron en Morandi & Camargo (2015), complementados por Bastos et al. (2017), Furlan & Laurindo (2017) y Yu et al. (2018).

La Tabla 1 del artículo, titulada “Protocolo para la Revisión Sistemática de la Literatura: Estrategia de Búsqueda”, detalla cada paso del proceso de revisión sistemática, siguiendo los principios de la metodología PRISMA.