

OPTIMIZACIÓN DE PORTAFOLIO

MÉTODOS NUMÉRICOS Y OPTIMIZACIÓN
INSTITUTO TECNOLÓGICO AUTÓNOMO DE MÉXICO

EQUIPO 4

Integrantes:

- Alberto Fuentes Chavarría
- León Felipe Gómez Zarza
- Ricardo Guillermo Granillo Alatorre
- Sergio Sánchez Reyes



Estructura de la presentación

- Teoría moderna del portafolio
- Metodología del portafolio eficiente
- Implementación del modelo
- Producto de datos
- Conclusiones



Preguntas

¿Qué características tiene el problema de optimización?

¿Qué tipo de problema de optimización es?

Entendimiento del método de optimización utilizado (vía una implementación por ejemplo).

¿Qué métodos existen para resolver el problema de optimización?

¿Cómo están resolviendo los métodos el problema de optimización?

Teoría del portafolio moderno

Preguntas

Metodología del portafolio eficiente

Preguntas

Implementación del modelo

Preguntas

Producto de datos

Preguntas

Conclusiones

Referencias

- H.M.Markowitz, Portfolio selection, Journal of Finance
- Paul Wilmott On Quantitative Finance
- Springer Series in Operations Research and Financial Engineering
- <https://plotly.com/python/v3/ipython-notebooks/markowitz-portfolio-optimization/>