

Mercados Financieros y Valuación de Instrumentos

Proyecto sobre Optimización de Portafolios con Markowitz

1 Instrucciones

(a) Descargar de Yahoo Finance cuatro ETFs de acciones desde 2010, en el reporte describe los activos de tu elección. Calcula los rendimientos diarios en PESOS mexicanos del activo financiero, reporta dentro del documento (reporte) la media, varianza, desviación estándar, matriz de covarianza, matriz de correlaciones, sesgo y exceso de curtosis. Calcula el rendimiento anualizado de las fechas mencionadas de los 4 ETFs y compáralos con el rendimiento del SPX, y compara sus desviaciones estándar.

(b) Calcula el portafolio óptimo bajo el criterio de optimización de media-varianza, esto con 4 diferentes niveles de aversión de riesgo. Para la tasa libre de riesgo considera el promedio desde 2010 de la tasa de referencia de Banxico. Muestra tus resultados y concluye.

(c) Calcula el portafolio óptimo donde busques alcanzar un rendimiento promedio de 13% con tasa libre de riesgo. Para la tasa libre de riesgo considera el promedio desde 2010 de la tasa de referencia de Banxico. Muestra tus resultados y concluye.

(d) Calcula el portafolio de mínima varianza y el portafolio tangente a la frontera eficiente. Muestra tus resultados y concluye.