



Universidad Champagnat
Facultad de Ciencias Económicas

Técnicas de aprendizaje estadístico con asimetrías para la optimización de carteras de inversión

Santiago Emiliano Eguren

Rodri

Cristian

Julio 2022

- 1 Introducción
- 2 Antecedentes
 - 2.1 Justificación
 - 2.2 Marco teórico
 - 2.3 Hipótesis
- 3 Conceptos principales
 - 3.1 Tempered Stable Paretian
 - 3.2 Medida del riesgo
- 4 Optimización de la cartera
 - 4.1 Optimización no paramétrica
 - 4.1.1 Sin restricción en los pesos
 - 4.1.2 Con restricción en los pesos
- 5 Conclusión
- 6 Anexos

Contents

1	Introducción	1
2	Antecedentes	1
2.1	Justificación	1
2.2	Marco teórico	1
2.3	Hipótesis	1
3	Conceptos principales	1
3.1	Tempered Stable Paretian	1
3.2	Medida del riesgo	1
4	Optimización de la cartera	1
4.1	Optimización no paramétrica	1
4.1.1	Sin restricción en los pesos	1
4.1.2	Con restricción en los pesos	1
5	Conclusión	1
6	Anexos	1