



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