Gestión Moderna de Portafolio

Una guía cuantitativa con aplicaciones en R y Python



Autores

Bernardo León Camacho, Carlos Andrés Zapata Quimbayo

Sinopsis

Presenta a nivel teórico y aplicado los principales desarrollos que han consolidado la teoría moderna de portafolio. Para ello, se presentan los elementos fundamentales del modelo media-varianza introducido por Markowitz en 1952 para la construcción de portafolios óptimos, así como sus principales extensiones mediante la incorporación de otras medidas de riesgo como: las medidas de semivarianza, el VaR o CVaR, entre otros; así como diferentes medidas de desempeño como: Sharpe, Sortino, Treynor, Omega, entre otras.Asimismo, se presentan diferentes formulaciones del problema de optimización de portafolio a partir de la incorporación de enfoques mucho más robustos como: el enfoque bayesiano, la optimización robusta de portafolio y el enfoque de paridad de riesgo. Además, se introducen los criterios ASG para el diseño de estrategias de inversión óptimas, los cuales permiten redefinir el modelo de optimización de portafolios para la incorporación de nuevas preferencias de los inversionistas.



Sobre el autor

Bernardo León Camacho

País: ColombiaEmail: bernardo.

Impreso

Año de publicación: 2023

Presentación: Trade paperback (EE.UU) (Libro)

Tamaño: 24 x 17 cm

Total de páginas numeradas: 208 Páginas

ISBN13: 9789588988795

2026 © Sistema Integrado de Metadata Estandarizada desarrollado por Hipertexto - Netizen

leon@cesa.edu.co Perfil ProfesionalEs ingeniero industrial, magíster en finanzas y candidato a doctor en economía de la Universidad de Salamanca, España.Perfil AcadémicoEs docente de cátedra en el Colegio de Estudios Superiores de Administración (CESA) y en la Facultad de Administración de la Universidad de Los Andes. Además, se ha desempeñado como profesor de cátedra en diferentes universidades del país en las áreas de finanzas cuantitativas, modelación financiera, mercado de capitales, entre otras.



Carlos Andrés Zapata Quimbayo

País: ColombiaEmail: cazapata25@gmail.comPerfil ProfesionalEs economista, magíster en finanzas y candidato a doctor en ciencias económicas de la Universidad Nacional de Colombia.Perfil AcadémicoEs docente investigador adscrito al Observatorio de Economía y Operaciones Numéricas (ODEON) del Centro de Investigaciones y ProyectosEspeciales (CIPE) de la Universidad Externado de Colombia. Se ha desempeñado como docente en las áreas de economía financiera, teoría de portafolio y métodos computacionales en finanzas.

E-Book

Año de publicación: 2024

Presentación: EPUB (Digital: descarga y online)

Tamaño: 5945577 Bytes

Número de páginas de la versión impresa: 208 Páginas

Número de páginas con contenido: 208 Páginas

ISBN13: 9789588988801

$45.000 COP

IBD

Año de publicación: 2024

Presentación: Libro

Tamaño: 24 x 17 cm

Número de páginas del contenido principal: 291 Páginas

ISBN13: 9789588988795

$83.222 ARS

Palabras clave

Gestión de portafolios; Mercado de capitales; Análisis de inversiones; Modelos de valoración mercado de capitales; Inversiones

2026 © Sistema Integrado de Metadata Estandarizada desarrollado por Hipertexto - Netizen