

Registro de la Propuesta del Trabajo Fin de Grado (TFG)

NOMBRE DEL ALUMNO: MARÍA PÉREZ CASADO

PROGRAMA: E2

GRUPO: B

FECHA: 05/10/2020

Director Asignado: ESCOBAR TORRES

Apellidos

LEANDRO SERGIO

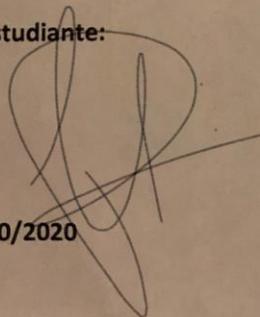
Nombre

Título provisional del TFG:

"El VaR como criterio de gestión de carteras"

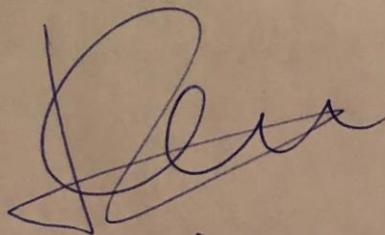
ADJUNTAR PROPUESTA (máximo 2 páginas: objetivo, bibliografía, metodología e índice preliminares)

Firma del estudiante:



Fecha: 05/10/2020

Firma del Director:



06/10/20.

ÍNDICE

1. INTRODUCCIÓN

1.1. Finalidad y contexto

1.2. Estado de la cuestión: justificación y motivación del trabajo

1.3. Estructura

1.4. Metodología

2. MARCO TEÓRICO DE UNA CARTERA DE INVERSIÓN

2.1. Definición y concepto

2.1.1. Composición

2.1.2. Gestión de carteras

2.2. Asignación de activos y políticas del inversor

2.3. Tipos de perfiles de riesgo

3. VALOR EN RIESGO (VaR)

3.1. Concepto y origen

3.2. Desarrollo

3.3. Metodología de cálculo

4. APLICACIÓN VaR COMO CRITERIO DE GESTIÓN DE CARTERA

4.1. Aspectos básicos y planteamiento caso

4.2. Estimación de factores de riesgo

4.3. Resolución caso práctico

4.4. Conclusión

5. CONCLUSIONES FINALES

6. BIBLIOGRAFÍA

OBJETIVO

El objetivo principal de este Trabajo de Fin de Grado es poder conocer en profundidad los conceptos de Valor en Riesgo (VaR) y de carteras de inversión (*portfolio*). Así mismo, se planteará un caso en que haya que aplicar el Valor en Riesgo como criterio de gestión de carteras, de tal manera que se pueda observar con claridad el efecto que produce sobre una misma cartera el usar este método de gestión o no usarlo.

METODOLOGÍA

La metodología de este trabajo es algo que por el momento no está muy claro. Por un lado, cabe la opción de plantear y estructurar una cartera por cuenta propia, y por otro lado coger una cartera modelo para cada tipo de perfil de riesgo y comparar. Dependiendo de la opción tomada la opción de poder usar el VaR histórico podría complicarse, debido a la posible falta de información o datos. La idea sería plantear de una manera teórica, la resolución y aplicación de las tres metodologías principales de cálculo de VaR, y también, tratar de verarlo de una manera práctica con aquellas metodologías que lo permitan.

Para la obtención de información se tratará de analizar y comparar distintos artículos, estudios, informes, tesis... de tal manera que se intente recopilar información fiable y fundamentada. Así mismo, tanto para la información como para los datos, se utilizarán fuentes como Bloomberg y webs oficiales (*ej: CNMV*).

BIBLIOGRAFÍA

Domínguez, I. L. *Valor en Riesgo (VAR)*. Ir a la portada de Expansion.com. <https://www.expansion.com/diccionario-economico/valor-en-riesgo-var.html>

Puente, J. *Tipos de fondos de inversión*. Fondos.com. <https://www.fondos.com/blog/tipos-de-fondos-de-inversion>

Stevens, R. (2020, January 20). *Valor en riesgo (VAR): cálculo y ejemplos*. <https://www.rankia.co/blog/analisis-colcap/3606512-valor-riesgo-var-calculo-ejemplos>

Vasileva, A. (2017, June 23). *Fondos Global Macro: un enfoque diferente para aprovechar las tendencias macroeconómicas*. <https://www.rankia.com/blog/fondos-inversion/3264615-fondos-global-macro-enfoque-diferente-para-aprovechar-tendencias-macroeconomicas>