



FCEA

FACULTAD DE
CIENCIAS ECONÓMICAS
Y DE ADMINISTRACIÓN



UNIVERSIDAD
DE LA REPÚBLICA
URUGUAY

— 80 AÑOS —
INSTITUTO DE ESTADÍSTICA

Modelo Black-Litterman en Optimización de portafolios: Aplicación a la eficiencia y regulación de los fondos de ahorro previsional en Uruguay. .

Andres Sosa ¹

Resumen:

En la presentación se introduce el modelo de optimización de portafolio de inversión denominado Black-Litterman. Este modelo fue propuesto con el fin de solucionar algunos de los inconvenientes que presentaba la teoría clásica. Se aplica este modelo a portafolios de inversión estructurados de manera similar a las Administradoras de Ahorro Previsional en Uruguay con el fin de evaluar la pertinencia de algunas modificaciones propuestas a la actual legislación. Entre otras, analizamos la idea de ampliar el espectro de activos financieros en los cuales pueden invertir estas instituciones, cambiar ciertos topes restrictivos como también generar mayor diferenciación de portafolios según tramo de edad o esquemas multifondos.

Miércoles 14 de junio

Será en modalidad mixta: presencial (Salón 4) y Sala virtual Zoom:

Hora 14:00 Modalidad Virtual: vía Zoom

ID Reunión Zoom: 875 6793 5996 / Contraseña: e1cKK@*Nk*

¹IESTA - FCEA