

ANNEX 8a. FULL DE RESUM DEL TREBALL DE FI DE GRAU DEL GNMI⁸

FULL DE RESUM DEL TREBALL DE FI DE GRAU DEL GNMI (ESCI-UPF)

| | |
|--|--------------------|
| TÍTOL DEL PROJECTE: construcció òptima d'una cartera d'inversió | |
| AUTOR/A: Albert Chumilla | NIA: 101054 |
| CURS ACADÈMIC: 2017-2018 | |
| DATA: 15/05/2018 | |
| DIRECTOR/S: Bernat Raventós Ruiz | |
| PARAULES CLAU (mínim 3) | |
| <ul style="list-style-type: none"> • Català: cartera, eficient, inversió, valor, Markowitz, gestió. • Castellà: cartera, eficiente, inversión, valor, Markowitz, gestión. • Anglès: efficient, portfolio, value, investing, Markowitz, management. | |
| RESUM DEL PROJECTE (extensió màxima: 100 paraules per llengua) | |
| <ul style="list-style-type: none"> • Català: En aquest treball es construeixen un conjunt de carteres eficients amb l'objectiu de superar l'índex de referència EUROSTOXX 50. La selecció dels actius es duu a terme mitjançant el criteri d'inversió en valor i posteriorment s'optimitzen les carteres utilitzant el model de Markowitz. Finalment, es realitza <i>backtesting</i> per tal de verificar si l'estratègia implementada pot aportar una rendibilitat superior a la del mercat en el futur. • Castellà: En este trabajo se construyen un conjunto de carteras eficientes con el objetivo de superar al índice de referencia EURSOTOXX 50. La selección de los activos se lleva a cabo mediante el criterio de inversión en valor i posteriormente se optimizan las carteras utilizando el modelo de Markowitz. Finalmente, se realiza <i>backtesting</i> para verificar si la estrategia implementada puede aportar una rentabilidad superior a la del mercado en el futuro. • Anglès: In this work, a set of efficient portfolios is built with the aim of surpassing the reference index EURSOTOXX 50. The selection of assets is carried out through value investing and then the portfolios are optimized using the Markowitz model. Finally, backtesting is executed to verify whether the strategy implemented can provide a higher return than the market in the future. | |

⁸ En compliment amb la Llei 15/1999, de 13 de desembre, de Protecció de Dades de Caràcter Personal, l'informem que les dades personals facilitades s'inclouran en un fitxer titularitat d'ESCI-UPF amb la finalitat de gestió acadèmica.