

Portada

Capítulo 1. Introducción.

Capítulo 2. Marco Teórico.

2.1 Teoría del portafolio.

2.2 La frontera factible y la frontera eficiente.

2.3 Existencia de títulos libres de riesgo en la frontera eficiente.

2.4 El modelo Capital Asset Pricing Model (C.A.P.M)

2.5 Riesgo de mercado y Beta.

2.6 Indicadores de desempeño de los portafolios.

2.7 Importancia de la volatilidad en la selección de portafolios.

2.8 Modelos heterocedásticos.

2.9 Estudios previos.

Capítulo 3. Sistema Financiero Mexicano y el surgimiento del Fondo de Inversión.

3.1 Antecedentes.

3.2 Fondos de Inversión en el mundo. Evolución reciente.

3.3 Activos Financieros.

3.4 Las Sociedades de Inversión.

3.5 Marco Jurídico y Normativo.

3.6 Tipos de sociedades de inversión

3.7 Evolución reciente de las sociedades de inversión.

3.8 Características del sistema de fondos de inversión.

3.9 Componentes de los fondos de inversión.

Capítulo 4. Análisis de riesgo y rendimiento para una pequeña muestra de los fondos de inversión mexicanos.

4.1 Los Datos.

Capítulo 5. Resultados.

5.1 Los resultados relativos mediante medidas de desempeño.

5.2 Análisis Econométrico.

5.3 Análisis de resultados de los modelos econométricos.

Conclusiones.

Bibliografía.

Anexos.