

La F óptima en la gestión de capital

Escrito por julenm - 24/01/2012 00:13

He encontrado esto en bolsa.com parece interesante lo conociais?

Uno de los métodos de gestión de capital más de moda consiste en utilizar la "f óptima" como ayuda para dimensionar el tamaño de las posiciones que tomamos en nuestra cartera. Sin embargo, no muchos de los que utilizan este método entiende realmente lo que la "f óptima" determina. Por eso he querido hoy hablar sobre ella e intentar desvelar "sus secretos".

Pero para poder entender mejor la "f óptima", debemos partir de otra fórmula también utilizada en la gestión de capital, la fórmula de Kelly. La fórmula de Kelly representa el valor óptimo de nuestro capital que debe invertirse para conseguir la máxima ganancia. Invirtiendo más o menos de ese valor, no se conseguirá una ganancia superior.

<http://bolsa.com/blog/la-f-optima-en-la-gestion-de-capital.html>

=====