



Cuadernos de Economía

ISSN: 0121-4772

revcuaeco_bog@unal.edu.co

Universidad Nacional de Colombia
Colombia

Villamil, Jaime

DIVERSIFICACIÓN Y VALOR EN RIESGO DE UN PORTAFOLIO DE ACCIONES

Cuadernos de Economía, vol. XXVI, núm. 47, julio-diciembre, 2007, pp. 175-204

Universidad Nacional de Colombia

Bogotá, Colombia

Disponible en: <http://www.redalyc.org/articulo.oa?id=282121960007>

Résumé

Dès les années cinquante la diversification du portefeuille a été formulée par Markowitz (1952 et 1956) comme un problème de programmation quadratique, en même temps que la déviation standard a été introduite comme mesure de risque. Au cours du temps, des algorithmes de solution plus efficaces ont été proposés, ainsi que des méthodologies plus complexes de mesure de risque des portefeuilles. Cet article décrit la méthode de l'ensemble actif en tant que solution du problème de programmation. Il fait une révision de l'approche de mesure de risques VeR (valeur en risque) et présente une application au marché des valeurs colombien.

Mots clés

Programmation convexe, sélection de portefeuille.

► Comment citer

► Numéro complet

► Plus d'informations de cet article

► Site Web du journal dans redalyc.org

redalyc.org

Système d'Information Scientifique

Réseau de revues scientifiques de l'Amérique latine, les Caraïbes, l'Espagne et le Portugal

Projet académique sans but lucratif, développé sous l'initiative pour l'accès ouverte