

# Portafolio básico

Se cuenta con datos de los retornos de 7 empresas y se cuenta con \$1,000.000 dólares para invertir en ellas.

Desee hacer su inversión tal que maximice el valor esperado de su retorno y que no sea demasiado riesgoso, por lo que desea que la desviación estándar de su portafolio no exceda 0,20.

De forma empírica sus expertos recomiendan no exponerse al riesgo y no invertir en IBM mas del 30% de la inversión.

## **Variables de decisión**

$X_i$  = porcentaje invertido en empresa  $i$  (\$)

Usar plantilla portafolio.xls