

Efficient Portfolio Optimization in the Wealth Creation and Maximum Drawdown Space

Borradores de Economía

Número:

520

Publicado:

Domingo, 1 Junio 2008

Clasificación JEL:

G11, G23, G32, D81

Palabras clave:

Efficient Portfolio Optimization in the Wealth Creation

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

[Precios de materias primas, poder de mercado y el aumento de la inflación de alimentos procesados en países en desarrollo: evidencia para Colombia](#)

Jorge Florez-Acosta, Margarita María Gáfaró-González, Alejandra González-Ramírez, Juan Sebastián Vélez-Velásquez

[Hechos Complementarios sobre el Ciclo Económico en Colombia: Una Perspectiva desde el Ciclo de Crecimiento](#)

Diego Vásquez-Escobar

[Comercio exterior de servicios en Colombia 1994-2024: Un análisis descriptivo](#)

Sandra Isabel Salamanca-Gil, Enrique Montes-Uribe, Juan Sebastián Silva-Rodríguez

[Otras Publicaciones](#)

First developed by Markowitz (1952), the mean-variance framework is the most widespread theoretical approximation to the portfolio problem. Nevertheless, successful application in the investment community has been limited. Assumptions such as normality of