

Efficient Portfolio Optimization in the Wealth Creation and Maximum Drawdown Space

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

[Documentos de Trabajo sobre Economía Regional y Urbana - El impacto de las tiendas de descuento en los mercados laborales locales: Evidencia de Colombia](#)

Lukas Delgado-Prieto, Andrea Sofía Otero-Cortés, Andrés Calderón

[Documentos de Trabajo sobre Economía Regional y Urbana - Desastres naturales, declaratoria de emergencia y corrupción](#)

Jhorland Ayala-García

[Borradores de Economía - Impuestos a la deuda durante las crisis, ¿bendición encubierta?](#)

Julián Andrés Parra-Polanía, Carmiña Ofelia Vargas-Riaño

[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