Efficient Portfolio Optimization in the Wealth Creation and Maximum Drawdown Space

Borradores de Economia
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

Dinámica Salarial, Desempleo e Inflación: Extendiendo el Modelo Semi-Estructural 4GM
Mario Andrés Ramos-Veloza, Sara Naranjo-Saldarriaga, José Pulido
Índices de Sentimiento e Incertidumbre de las noticias económicas de Colombia
Rocío Clara Alexandra Mora-Quiñones, Antonio José Orozco-Gallo, Dora Alicia Mora-Pérez
Billeteras móviles y otros servicios de pago: brechas regionales y su adopción en Colombia
Constanza Martínez-Ventura, Ligia Alba Melo-Becerra
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