

Portfolio Optimization and Long-Term Dependence

Borradores de Economía

Número:

622

Publicado:

Miércoles, 1 Septiembre 2010

Clasificación JEL:

G11, G32, G20, C14

Palabras clave:

Portfolio optimization, Hurst exponent, long-term dependence, biased random walk

[Descargar documento](#)

Lo más reciente

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

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

[Impacto de los cierres en la vía al llano sobre los precios de los alimentos en Colombia](#)

Jhorland Ayala-García, Yesica Tatiana Lara-Silva, Alejandro Alberto Vargas-Villamil, Lina Romero-Chaparro

[Impacto macroeconómico y fiscal del cambio demográfico](#)

Jesús Alonso Botero-García, Ligia Alba Melo-Becerra, Cristian Castrillón Gaviria, Daniela Gallo

[Otras Publicaciones](#)

Whilst emphasis has been given to short-term dependence of financial returns, long-term dependence remains overlooked. Despite financial literature provides evidence of long-term's memory existence, serial-independence assumption prevails. This document