Portfolio Optimization and Long-Term Dependence - Portal de Investigaciones

Portfolio Optimization and Long-Term Dependence

Borradores de Economia

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 <u>Descargar documento</u>

Lo más reciente

<u>Productividad y eficiencia de los hospitales públicos en Colombia por niveles de complejidad:</u> Nueva evidencia 2007 - 2021

Diego Vásquez-Escobar

Estructura tributaria y desempeño de las firmas colombianas

Juan Esteban Carranza-Romero, Alejandra González-Ramírez, Mauricio Villamizar-Villegas Presupuesto de la nación y el balance fiscal del gobierno central: ¿cómo se relacionan y qué los diferencia?

Hernán Rincón-Castro, Steven Zapata-Álvarez

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