De acordo com a teoria de Markowitz, existe uma carteira ótima que poderia ser desenhada com um equilíbrio perfeito entre risco e retorno. A carteira ótima não inclui apenas títulos com maior potencial de retorno ou títulos com menor risco. A carteira ótima visa equilibrar os títulos com maior potencial de retorno com um nível de risco aceitável. Está ótima carteira é o que procuramos.

A forma de gerenciamento proposta é dada pelo controle da porcentagem de cada ativo dentro do portfólio, essa porcentagem será chamada de **peso** dos ativos. Observando que os ativos são pré-selecionados, o modelo não pode fazer novos aportes de ativos, porém pode zerar o peso de um ativo caso considere benéfico para o critério de otimização empregado.