The Factor-Portfolios Approach to Asset Management using Genetic Algorithms

Borradores de Economia
Número:
511
Publicado:
Martes, 1 Abril 2008
Clasificación JEL:
G11, G14, G32
Palabras clave:
Active Management, Portfolio optimization, Genetic Algorithms, Propensities.
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

We present an investment process that: (i) decomposes securities into risk factors; (ii) allows for the construction of portfolios of assets that would selectively expose the manager to desired risk factors; (iii) perform a risk allocation between these p