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

Fragile wholesale deposits, liquidity risk, and banks' maturity transformation
Carola Müller, Matias Ossandon Busch, Miguel Sarmiento, Freddy A. Pinzón-Puerto
Un análisis de cohortes de la brecha de género en la participación laboral en Colombia
Francisco Javier Lasso-Valderrama, Mario Andrés Ramos-Veloza
Simulación dinámica de balances y predicción del incumplimiento crediticio: un modelo de prueba de estrés para firmas colombianas
Diego Fernando Cuesta-Mora, Gómez-Molina Andrés Camilo
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