

The Factor-Portfolios Approach to Asset Management using Genetic Algorithms

Borradores de Economía

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

[Precios de materias primas, poder de mercado y el aumento de la inflación de alimentos procesados en países en desarrollo: evidencia para Colombia](#)

Jorge Florez-Acosta, Margarita María Gáfaró-González, Alejandra González-Ramírez, Juan Sebastián Vélez-Velásquez

[Hechos Complementarios sobre el Ciclo Económico en Colombia: Una Perspectiva desde el Ciclo de Crecimiento](#)

Diego Vásquez-Escobar

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

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

[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