

## عنوان مقاله:

تأثیر تغییر نرخ انقلاب در الگوریتم رقابت استعماری بر کارآمدی پرتفوی بهینه

## محل انتشار:

سومین کنفرانس بین المللی مدیریت، تجارت جهانی، اقتصاد، دارایی و علوم اجتماعی (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

## نویسندگان:

ابوب گودرزی - کارشناسی ارشد مهندسی سیستمهای مالی، دانشکده علوم مالی، دانشگاه خوارزمی

فرزاد فروغی مجد - کارشناسی ارشد مهندسی سیستمهای مالی، دانشکده علوم مالی، دانشگاه خوارزمی

## خلاصه مقاله:

از زمان معرفی نظریه نوین پرتفوی توسط مارکوویتز تاکنون، مطالعات متعددی در این خصوص صورت پذیرفته است. برخی از این مطالعات به ارائه معیارهای متفاوت برای بازده انتظاری و به صورت ویژه معیار ریسک پرداخته و مطالعات زیادی نیز سعیدر نزدیک نمودن مسئله به شرایط دنیای واقعی از طریق اضافه نمودن محدودیت های مناسب نموده اند. محدودیت های موجود در حل مسئله از طریق شیوه های دقیق، سبب گردیده تا شیوه های جایگزین در بهینه سازی پرتفوی مورد توجه و اهتمام جدی قرار گیرد. یکی از این شیوه های مورد توجه زیاد محققان، استفاده از روش های فراابتکاری برای حل مسئله بهینه سازی پرتفوی است. در استفاده از این شیوه ها، انتخاب پارامترهای مناسب و تأثیر آن بر جواب نهایی، همواره یکی از دغدغه های پژوهشگران بوده است. از این رو، در این تحقیق سعی شده است تا تحلیل حساسیت تغییر پارامتر انقلاب در الگوریتم جدید رقابت استعماری بر کارآمدی پرتفوی بهینه در بورس اوراق بهادار تهران مورد ارزیابی قرار گیرد. نتایج به دست آمده نشان میدهد که با افزایش پارامتر انقلاب، پرتفویهای با کارآمدی پایین تری را نتیجه می دهد.

## کلمات کلیدی:

بهینه سازی پرتفوی، مدل میانگین-نیم واریانس، الگوریتم رقابت استعماری، پارامتر انقلاب، ضریب جذب

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1046758>

