

## عنوان مقاله:

انتخاب بهینه سبد سهام با استفاده از الگوریتم ترکیبی هوش جمعی سالپ و سینوس کسینوس و شبکه‌های عصبی روبه جلو

## محل انتشار:

فصلنامه مدیریت کسب و کار، دوره 12، شماره 49 (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 29

## نویسندگان:

سیدعلی حسینی - گروه حسابداری، واحد تهران مرکزی، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

علی اسماعیل زاده مقری - گروه حسابداری، واحد تهران مرکزی، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

آریتا جهانشاد - گروه حسابداری، واحد تهران مرکزی، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

## خلاصه مقاله:

انتخاب بهینه سبد سهام یک مسئله بهینه سازی است که توسط الگوریتم های فراابتکاری قابل حل است. قدرت جستجو در الگوریتم فراابتکاری ارتباط مستقیم با دقت انتخاب بهترین سهام در سبد پرتفوی دارد. الگوریتم هوش جمعی سالپ از الگوریتم های فراابتکاری جدید است که در انتخاب سبد بهینه سهام، نتایج خوبی داشته است. در این تحقیق راهکاری جدید جهت تقویت قدرت جستجو در الگوریتم هوش جمعی سالپ با استفاده از الگوریتم سینوس کسینوس ارائه شده است. در تحقیقات مشاهده می شود که مدل ریاضی میانگین واریانس مارکویتز یکی از اصلیتیرین راهکارها جهت انتخاب بهینه سبد سهام است اما بهتر است معیارهایی همچون چولگی با در نظر گرفتن پتانسیل آینده سهام نیز بررسی شود. در این تحقیق از ۲۰ شرکت اول از ۵۰ شرکت برتر سه ماهه اول سال ۱۳۹۸ استفاده شده است. در این تحقیق با استفاده از شبکه عصبی روبه جلو، پیش بینی قیمت پایانی آینده سهام انجام شده و سپس با استفاده از الگوریتم جدید هوش جمعی سالپ سینوسی کسینوسی جهت انتخاب بهینه سبد سهام استفاده می شود. نتایج تحقیق بیانگر آن است که مدل های ارائه شده در این مقاله، در مقایسه با روشهای سنتی و شاخص بازار، بازدهی بالاتری را برای سرمایه گذاران فراهم می نماید.

## کلمات کلیدی:

سبد بهینه سهام، الگوریتم هوش جمعی سالپ، الگوریتم سینوس کسینوس، شبکه های عصبی روبه جلو

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1186869>

