

عنوان مقاله:

بهینه سازی سبد سهام با استفاده از الگوریتم بهینه سازی مبتنی بر آموزش و یادگیری (TLBO) در بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات مالی، دوره 19، شماره 2 (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 18

نویسندگان:

ابوذر سروش - دکتری مدیریت مالی، دانشکده مدیریت، دانشگاه تهران، تهران، ایران

رومینا عطرجی - دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی مالی، دانشکده مدیریت، دانشگاه تهران، تهران، ایران

شاهین رامتین نیا - دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی مالی، دانشکده مدیریت، دانشگاه تهران، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

افزایش بازده و کاهش ریسک، همواره یکی از مهم ترین مسائلی است که سرمایه گذاران در بازارهای مالی به آن توجه می کنند. با وجود سابقه طولانی بهینه سازی سبد سهام، الگوریتم بهینه سازی مبتنی بر آموزش و یادگیری که در سال ۲۰۱۰ معرفی شده است، یکی از کاراترین روش های فرا ابتکاری، برای حل مسائل بهینه سازی است. در این پژوهش، سعی شده است مسئله بهینه سازی سبد سهام، در چارچوب مدل معرفی شده مارکوویتز، با استفاده از الگوریتم بهینه سازی مبتنی بر آموزش و یادگیری حل شود. بدین منظور، از بازدهی های روزانه ۲۰ شرکت پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران که دارای نقدینگی بالا در بازه زمانی ۱۳۹۱ تا ۱۳۹۵ بودند، استفاده شده است. نتایج به دست آمده از این تحقیق نشان می دهد الگوریتم بهینه سازی مبتنی بر آموزش و یادگیری، نسبت به سایر الگوریتمها برای یافتن مرز کارا و بهینه سازی سبد سهام، عملکرد بهتری دارد.

کلمات کلیدی:

ارزش در معرض ریسک مشروط، الگوریتم بهینه سازی مبتنی بر آموزش و یادگیری، بهینه سازی سبد سهام، روش های فرا ابتکاری، مدل میانگین واریانس

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1394969>

