

عنوان مقاله:

پیاده سازی الگوریتم فراابتکاری جهت انتخاب پرتفوی بهینه (مطالعه موردی بورس اوراق بهادار تهران)

محل انتشار:

هفدهمین کنفرانس ملی رویکردهای نوین در مدیریت، اقتصاد و حسابداری (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 11

نویسندگان:

سارا بیگ جانی - گروه مهندسی صنایع، واحد علی آباد کتول، دانشگاه آزاد اسلامی، علی آباد کتول، ایران

حسین دیده خانی - گروه مهندسی صنایع، واحد علی آباد کتول، دانشگاه آزاد اسلامی، علی آباد کتول، ایران.

خلاصه مقاله:

سرمايه گذاري در بين شركت هاي مالي، صنايع و ساير بخش هاي مختلف با يك عامل ريسك همراه است. تنوع-بخشي مهارتي است كه براي كاهش اثرات اين گونه ريسك ها استفاده مي شود و ايجاد سبد سهام تكنيكي است كه در تنوع-بخشي به كار مي رود. پژوهش حاضر با استفاده از الگوريتم ژنتيك سعی در بهينه سازی تصمیم گیری در انتخاب پرتفوی را دارد. برای تعیین اثربخشی الگوریتم، معیارهای دقیق آن محاسبه شده است. از شرکت های فعال پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران به عنوان نمونه استفاده گردید. در واقع برای انتخاب پرتفوی بهینه مدل مارکوییتز از طریق این الگوریتم در محیط متلب حل شد. همچنین معیارهای شارپ، کارایی و ریسک برای هر پرتفوی محاسبه شدند. یافته ها نشان می دهند بهینه سازی پرتفوی انتخاب شده توسط الگوریتم ژنتیک عملکرد بهتری دارد.

کلمات کلیدی:

مدیریت پرتفوی، مدل مارکوییتز، الگوریتم ژنتیک، بهینه سازی پرتفوی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1548894>

