

عنوان مقاله:

بهینه سازی سبد سهام با الگوریتم های مختلف

محل انتشار:

فصلنامه چشم انداز حسابداری و مدیریت، دوره 6، شماره 79 (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 8

نویسندگان:

رحمان رحیمی - استاد مدعو گروه حسابداری، واحد تهران جنوب، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران.

آیدا اکبری - دانشجوی کارشناسی حسابداری، واحد تهران جنوب، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

انتخاب سبد سهام یکی از مباحث مهم در حوزه مدیریت سرمایه گذاری بوده که در رابطه با نحوه تخصیص سرمایه یک سرمایه گذار به دارایی های مختلف و تشکیل یک پرتفوی کارا بحث می کند که هرچه مفروضات و شرایط مدل سازی جهت انتخاب و بهینه سازی سبد سرمایه گذاری به شرایط دنیای واقعی نزدیکتر باشد، نتایج حاصل از آن بیشتر قابل اتکا خواهد بود. در نظر گرفتن افق تک دوره ای برای سرمایه گذاری چندان واقعی نبوده و بیشتر سرمایه گذاران برای بیش از یک دوره اقدام به سرمایه گذاری می کنند که سرمایه گذار بتواند موقعیت خود را در طول زمان مورد بازنگری قرار دهد. الگوها و روش های مختلفی از زمان ارائه کار اولیه مار کویتز تا کنون برای انتخاب سبد سرمایه گذاری بهینه ارائه شده است. با این حال یافتن مفیدترین الگو در انتخاب این سبد همواره دغدغه سرمایه گذاران بوده است. در این پژوهش تعدادی از الگوریتم های بهینه سازی سبد سهام مانند الگوریتم مورچگان، الگوریتم ژنتیک، الگوریتم فرهنگی، الگوریتم ازدحام ذرات، الگوریتم کرم شب تاب، آورده شده است که در مورد هر کدام به صورت مختصر توضیح داده شده است.

کلمات کلیدی:

الگوریتم ژنتیک، بهینه سازی، الگوریتم ازدحام ذرات، الگوریتم کرم شب تاب، الگوریتم مورچگان

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1684425>

