

عنوان مقاله:

بهینه سازی پرتفوی چند دوره ای با استفاده از الگوریتم PSO

محل انتشار:

نهمین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

نویسندگان:

سیامک موشخیان - دانشجوی کارشناس ارشد مهندسی مالی

امیرعباس نجفی - استادیار دانشگاه صنعتی خواجه نصیرالدین طوسی

جلال باقرزاده - دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی مالی

خلاصه مقاله:

در این مقاله پرتفوی چنددوره ای با تابع میانگین نیم واریانس امکان سرمایه گذاری مجدد و بازنگری در ابتدای هردوره به کمک الگوریتم PSO و GA بررسی شده و عدم قطعیت به شکل سناریوهای با احتمالات مشخص در نظر گرفته شده است در تمامی مطالعاتی که تاکنون انجام شده مقدار پولی که به هردارایی اختصاص داده شده به عنوان متغیر تصمیم در نظر گرفته شده است درحالیکه در این مقاله وزنی که به هردارایی اختصاص داده میشود به عنوان متغیر تصمیم در نظر گرفته شده است مزیت اصلی این کار کاهش فضای جواب است که باعث بهبود زمان رسیدن به جواب بهینه می شود در تحقیق عملی تعداد دوازده سهم از بورس اوراق بهادار تهران انتخاب و مدل پرتفوی چنددوره ای با تابع هدف میانگین نیم واریانس توسط الگوریتم های PSO و GA^{*} اجرا شد نتایج نشانگر آن است که جوابهای بدست آمده از الگوریتم PSO در تعداد تکرارهای پایین بهتر از GA است.

کلمات کلیدی:

بهینه سازی پرتفو، پرتفوی چنددوره ای، بهینه یابی احتمالی، میانگین - نیم واریانس، الگوریتم بهینه یابی هوش جمعی ذرات

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/189191>

