

عنوان مقاله:

استفاده از روش های بهینه سازی و الگوریتم های تکاملی در بهبود استراتژی های مدیریت ریسک

محل انتشار:

نهمین همایش بین المللی مدیریت و حسابداری ایران (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

علی کیانی فر - دانشجوی دکتری دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران جنوب

محسن حمیدیان - استادیار دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران جنوب

الناز سبزه ئی - دانشجوی دکتری دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران جنوب

خلاصه مقاله:

مدیریت ریسک در صنعت سرمایه گذاری و مدیریت سرمایه از اهمیت ویژه ای برخوردار است و استفاده از روش های بهینه سازی و الگوریتم های تکاملی می تواند در بهبود استراتژی های مدیریت ریسک موثر باشد. در این مقاله، به بررسی این موضوع پرداخته شده است. روش های بهینه سازی شامل الگوریتم های مختلفی همچون الگوریتم ژنتیک، الگوریتم تکامل تفاضلی، و الگوریتم تکامل استراتژیک مورد بررسی قرار گرفته اند. در این تحقیق، ابتدا به معرفی مفاهیم اصلی مدیریت ریسک پرداخته شده و سپس به توضیح مزایا و معایب استفاده از روش های بهینه سازی و الگوریتم های تکاملی در این زمینه پرداخته شده است. سپس، با بررسی کاربردهای الگوریتم های تکاملی در مدیریت ریسک و ارائه مطالعات موردی، نتایج حاصل از استفاده این روش ها در بهبود عملکرد استراتژی های مدیریت ریسک بررسی شده است. نتایج این مقاله نشان می دهد که استفاده از الگوریتم های تکاملی می تواند بهبود قابل توجهی در مدیریت ریسک داشته باشد. این روش ها با توانایی پیش بینی دقیق تر و تطبیق بهتر با شرایط بازار، می توانند به بهبود عملکرد و کاهش ریسک های مرتب با سرمایه گذاری ها کمک کنند. در نتیجه، استفاده از روش های بهینه سازی و الگوریتم های تکاملی به عنوان ابزاری موثر در بهبود استراتژی های مدیریت ریسک توصیه می شود.

کلمات کلیدی:

مدیریت ریسک، هوش مصنوعی، الگوریتم ژنتیک، الگوریتم تکامل تفاضلی، مدل سازی ریسک، شبکه عصبی، بهینه سازی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1981989>

