

عنوان مقاله:

به کارگیری الگوریتم ممتیک در حل مسئله ی انتخاب سبد بهینه ی سهام با محدودیت حداقل اندازه ی مبادله

محل انتشار:

دهمین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع (سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

نویسندگان:

بهروز کریمی - دانشیار دانشکده مهندسی صنایع دانشگاه صنعتی امیرکبیر

حسین دستخوان - دانشجوی دکتری مهندسی صنایع دانشگاه صنعتی امیرکبیر

رضا میهمی - دانشجوی دکتری مهندسی صنایع دانشگاه صنعتی امیرکبیر

خلاصه مقاله:

مساله انتخاب سبد بهینه ی سهام یکی از مهمترین مسائل ادبیات مالی است. با افزایش تعداد سهام مورد نظر برای تشکیل یک سبد سهام بهینه، امکان حل این مسئله از طریق روش های دقیق وجود ندارد. بنابراین استفاده از الگوریتم های تقریبی، به ویژه الگوریتم های ابتکاری و فراابتکاری راهکاری مناسب به نظر می رسد. در این مقاله، یک مدل انتخاب سبد سهام بر مبنای اندازه ی ریسک واریانس و با در نظر گرفتن محدودیت های صحیح بودن اندازه ی مبادله و حداکثر و حداقل تعداد سهام در سبد، با استفاده از الگوریتم فراابتکاری ممتیک حل شده است. برای نمایش کارایی الگوریتم، یک مثال عددی متشکل از یک سبد 30 سهمی در بازار بورس تهران ارائه شده است. نتایج حاصل از پژوهش نشان می دهد که الگوریتم ممتیک کارایی خود را در حل مساله انتخاب سبد بهینه مانند سایر مسائل بهینه سازی ترکیبی نشان می دهد.

کلمات کلیدی:

انتخاب سبد سهام، الگوریتم ممتیک، محدودیت حداقل اندازه مبادله، بورس تهران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/284138>

