

عنوان مقاله:

روش فازی چندهدفه در انتخاب بهینه پورتفولیو با استفاده از الگوریتم ژنتیک

محل انتشار:

همایش بین المللی مدیریت (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 11

نویسندگان:

صافورا صادقی - دانشجوی کارشناسی ارشد، دانشکده مدیریت، دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران مرکز، ایران

فرهاد حنیفی - استادیار، دانشکده مدیریت، دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران مرکز، ایران

ایمان گروهی ساردو - دانشجوی دکتری تخصصی، دانشکده مهندسی برق و کامپیوتر، دانشگاه شهید بهشتی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

همواره هدف سرمایه گذاران کسب حداکثر بازده مورد انتظار در یک سطح قابل قبول از ریسک می باشد. این مقاله به ارائه یک الگوریتم ژنتیک بر مبنای روش فازی چندهدفه برای حل مسأله انتخاب پورتفولیو می پردازد. انتخاب بهینه پورتفولیو توأم با هدف حداکثر کردن بازگشت سرمایه دارایی های انتخاب شده و کاهش ریسک حاصل از آن صورت می-گیرد. چون الگوریتم ژنتیک نیاز به اطلاعات مشخصی از مسأله ندارد، بنابراین قابلیت انعطاف بیشتری نسبت به سایر روش ها دارد. همچنین این الگوریتم قادر به مدلسازی رفتار غیرخطی سهام در بازار می باشد. در این مقاله از روش جمع وزنی جهت حل مسأله چند هدفه پیشنهادی استفاده میشود. ضرائب وزنی توابع هدف با استفاده از روش فازی و با توجه به نظرات تصمیم گیرنده به دست می آیند. همچنین با حل مسأله برای ضرائب وزنی مختلف، منطقه کارا توابع هدف بازدهی و ریسک محاسبه میشود. کارایی روش پیشنهادی با استفاده از مطالعه موردی قیمت بسته شده چندین سهام شرکت های تجاری بزرگ اثبات شده است.

کلمات کلیدی:

پورتفولیو، بازگشت سرمایه، ریسک، الگوریتم ژنتیک، روش فازی چند هدفه

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/343663>

