

عنوان مقاله:

کاربرد الگوریتم گروه ذرات درانتخاب بهینه سبد سهام از دیدگاه ریسک گریزی مشتری

محل انتشار:

همایش بین المللی مدیریت (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

مریم فاخری نیا - کارشناس ارشد مدیریت مالی

منصور زراءنژاد - استاد دانشکده اقتصاد دانشگاه شهید چمران، اهواز

رضا یوسفی حاجی اباد - استادیار گروه اقتصاد دانشگاه پیام نور، تهران

خلاصه مقاله:

همواره انتخاب سودآور مساله اصلی بشری در مواجهه با مسائل اقتصادی بوده است.. آنچه که ذهن خریداران و سرمایهگذاران را مشغول میسازد نگرانی از سودده ماندن سرمایه است. واینکه دراین راستا با سرمایه محدودخودکمترین ریسک را در مقابل بیشترین بازده کسب کنند.ریسک گریز بودن مشتری یکی از مهمترین عوامل درسرمایه گذاری است بر همین اساس ما با استفاده از مدل میانگین واریانس مارکوویتز مدل ریسک مشتری را برای توجه به ریسک گریزی سرمایه گذار انتخاب کردیم واین مدل را از طریق الگوریتم گروه ذرات حل نمودیم. تا بهینه ترین انتخاب با توجه ریسک گریزی مشتری در انتخاب سهام را بدست آوریم.از این رو اینتحقیق با بررسی ادبیات موضوع در گام اول و شناسایی مدلهای مطرح در این زمینه، در قدمهای بعدی خود درصدد است تا راهکارهایی برای مواجهه با این امر ارائه نماید. الگوریتم انتخاب شده در این زمینه، الگوریتمحرکت دسته پرنندگان، را میتوان جزو الگوریتم جمعیت محوری دانست که سابقه بررسی وبهبود طولانی در ادبیات بحث دارند. جامعه آمادی این تحقیق سهام شرکت های بورس تهران دریک دوره 5ساله 6831 تا 6836 است.نتایج این تحقیق نشان میدهد که استفاده از این الگوریتمها میتواند جوابهایی نزدیک به هم و نیز نزدیک به بهینگی ایجاد نموده و سبب اطمینان تصمیم سرمایهگذاران شود لیکن باید این نکته را در نظر داشت که بعلت تاثیر عوامل برونزا همچنان انتخاب سبد بهینه کمی دشوار به نظر خواهد رسید

کلمات کلیدی:

انتخاب سبد سهام مدل مارکوویتز الگوریتم گروه ذرات

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/343884>

