

عنوان مقاله:

تحلیل حساسیت مسئله ی انتخاب سبد سهام

محل انتشار:

سومین کنفرانس ریاضیات مالی و کاربردها (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسندگان:

محمدرضا صافی - دانشکده ریاضی، آمار و علوم کامپیوتر، گروه ریاضی دانشگاه سمنان

الهام فرزانه - دانشکده ریاضی، آمار و علوم کامپیوتر، گروه ریاضی دانشگاه سمنان

خلاصه مقاله:

در این مقاله، مسئله انتخاب سبد سهام را به صورت یک مسئله برنامه ریزی کسری فازی در نظر می گیریم. ابتدا به کمک نرخ شارپ، مسئله را بیان نموده، سپس با استفاده از تغییر متغیر چارنز و کوپر آن را از حالت کسری خارج می کنیم. با استفاده از سطوح انتظار توابع عضویت، مسئله به حالت قطعی تبدیل می شود که با روش های مربوط به مسائل غیرخطی قابل حل است. علاوه بر این، حساسیت مسئله نسبت به تغییرات توابع عضویت نیز مورد بررسی قرار می گیرد.

کلمات کلیدی:

مسئله انتخاب سبد سهام، برنامه ریزی فازی تصادفی، تحلیل حساسیت، نرخ شارپ

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/352570>

