

عنوان مقاله:

بهینه سازی پرتفولیو با سه تابع هدف و متغیرهای گسسته

محل انتشار:

چهارمین کنفرانس ملی و دومین کنفرانس بین المللی حسابداری و مدیریت (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

نویسنده:

امیرسپهر زمردی نیا - دانشجوی کارشناسی ارشد، دانشگاه علم و صنعت ایران، دانشکده مهندسی صنایع

خلاصه مقاله:

در این مقاله هدف مدلسازی انتخاب پرتفولیو به شکل یک مسأله بهینه سازی سه هدفه و به منظور ایجاد یک تعامل بین ریسک، بازگشت سرمایه و تعداد دارایی ها ایجاد می گردد. در نهایت به منظور حل مدل ارایه شده از سه الگوریتم فراابتکاری استفاده می گردد. مدلمیانگین- واریانس که توسط مارکوویتز ارائه گردید، یکی از مدل هایی است که به طور گسترده در مسئله انتخاب سبد سهام مورد استفاده قرار می گیرد. باید توجه داشت که هرچند این مدل از لحاظ نظری با روش برنامه ریزی ریاضی قابل حل است اما در عمل مشکلاتی در این زمینه وجود دارد. اولاً، محدودیتهایی که در دنیای واقعی وجود دارد، در مدل مارکوویتز در نظر گرفته نشده است. همانند محدودیت تعداد سهام ثابت در پرتفوی، هزینه های معاملاتی، معامله سهام در دسته های ثابت، و

کلمات کلیدی:

بهینه سازی، بهینه سازی پرتفولیو، سبد سهام، الگوریتم ژنتیک

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/427897>

