

## عنوان مقاله:

بهینه سازی سبد سهام بازارهای مالی با بکارگیری الگوریتم های کرم شبتاب و حرکت پرندگان

## محل انتشار:

کنفرانس بین المللی پژوهش های کاربردی در فناوری اطلاعات، کامپیوتر و مخابرات (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

## نویسنده:

رهام افضل

## خلاصه مقاله:

ردیابی شاخص ، مسئله ساختن سبد سهامی است که شاخص معینی را در یک بازه زمانی خاص ردیابی می کند. برای باز سازی شاخص نیاز به مقدار زیادی سرمایه برای سرمایه گذاری بر روی کلسهام است . با توجه به تعداد زیاد شرکتهای پذیرفته شده در بورس امکان خرید همه سهام وجود ندارد. یکی از راهها، سرمایه گذاری بر روی تعداد محدودی سهام به منظور ایجاد رفتاری مشابه شاخص است . دغدغه مدیران منفعل سرمایه که این استراتژی را دنبال می کنند ، پیدا کردن اینپورتفوی است که به طور بهینه شاخص را ردیابی کند. با توجه به ابعاد بزرگ مسئله که مسئله ترکیباتی است ، حل آن در زمان چند جمله ای تقریبا غیر ممکن است . از این رو در این تحقیق با استفاده از روشهای فرا ابتکاری جدید کرم شب تاب و حرکت پرندگان اقدام به حل این مسئله در شاخص های معتبر دنیا مانند S&P500 و Hang Seng و همچنین در بازار سهام تهران (TEPIX) شده است در این تحقیق با استفاده از الگوریتم های فرا ابتکاری جدید سعی در حل مسئله بهینه سازی مدیریت منفعل پورتفوی شد. دقت ردیابی الگوریتم و همبستگی بالای سبد سهامو شاخص ، خصوصا در بازار های مالی با ثبات بالا ، نشان از توانایی حل این مسئله توسط اینالگوریتم ها است.

## کلمات کلیدی:

ردیابی شاخص، پورتفوی ردیابی کننده، الگوریتم کرم شب تاب، الگوریتم ژنتیک، برنامه ریزی کوادراتیک

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/450908>

