

عنوان مقاله:

انتخاب پرتفولیوی بهینه با استفاده از الگوریتم رقابت استعماری گسسته

محل انتشار:

کنفرانس بین المللی جهت گیری های نوین در مدیریت، اقتصاد و حسابداری (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسندگان:

احمد لطفی - کارشناسی ارشد تحقیق در عملیات، دانشگاه صنعتی سهند تبریز

مهدی محمدی - دانشجوی کارشناسی ارشد اقتصاد اسلامی، دانشگاه آزاد واحد سلماس

خلاصه مقاله:

تشکیل پرتفوی به عنوان یک تصمیم حساس و حیاتی برای سرمایه‌گذاران بازار سرمایه شناخته شده است. به همین دلیل انتخاب یک پرتفوی با نرخ بازدهی بالا و ریسک کنترل شده یکی از موضوعاتی است که مورد توجه بسیاری از محققان قرار گرفته است. مدیران در تصمیمات خود جهت انتخاب پرتفو مناسب به طور همزمان چندین هدف را مد نظر قرار می دهند. که این اهداف ممکن است در مواقعی با هم در تعارض باشند. در این مقاله سعی شده است تا با استفاده از الگوریتم رقابت استعماری گسسته مسئله انتخاب سبد سهام با حداقل معامله حل گردد. مدل مذکور در زمره مسائل با پیچیدگی زمانی بالا می باشد. لذا برای بدست آوردن جواب این مسائل در ابعاد بالاتر از الگوریتم رقابت استعماری استفاده شده است. همچنین برای نشان دادن کارایی این الگوریتم، نتایج حاصل را مورد بررسی قرار داده ایم. زمان حل مسئله توسط الگوریتم در بازه مورد قبولی قرار دارد. نمونه پژوهش از شرکت های فعال در بورس اوراق بهادار تهران در سالهای 1388 تا 1390 انتخاب گردیده است. نتایج نشان دهنده آن است که در حل این مدل با استفاده از الگوریتم رقابت استعماری گسسته ضمن بدست آمدن زمان کمتر و قابل قبول، جوابهای بهتری نیز بدست می آید.

کلمات کلیدی:

تصمیم گیری، انتخاب سبد سهام، الگوریتم رقابت استعماری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/454804>

