

عنوان مقاله:

ارائه مدل بهینه پرتفوی سهام با استفاده از الگوریتم تبرید شبیه سازی شده و الگوریتم ابتکاری ترکیبی جستجوی ممنوع و تبرید شبیه سازی شده

محل انتشار:

دومین کنفرانس بین المللی مدیریت و علوم انسانی (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

نویسنده:

سارا زیاری - عضو هیأت علمی موسسه آموزش عالی فاطمیه (س) شیراز

خلاصه مقاله:

مدل میانگین-واریانس مارکویتز، به دلیل فرضیه های غیرواقع گرایانه مورد انتقادات زیادی قرار گرفت، لذا در این مقاله، برای مدنظر قرار دادن شرایط و محدودیت های دنیای واقعی با افزودن مؤلفه های مقید، مدل برنامه ریزی عدد صحیح مختلط جایگزینمدل بهینه سازی کلاسیک میشود. برای حل مدل مورد استفاده در این پژوهش، از الگوریتمهای تبرید شبیه سازی شده و ترکیب دو الگوریتم فراابتکاری جستجوی ممنوع و تبرید شبیه سازی شده استفاده شده است. هدف اصلی این مقاله، ارزیابی کارایی الگوریتمهای مزبور در ارائه جوابهای با کیفیت بالا و در زمان قابل قبول برای حل مسئله بهینه سازی پرتفوی سهاماست. نتایج ارزیابی مرز کارای مدل میانگین-واریانس و مرز کارای به دست آمده با استفاده از الگوریتم SA و TS-SA برای 50 شرکت پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران در دوره 30 ماهه منتهی به شهریور ماه 1393 حاکی از آن است که هردو الگوریتم توانایی نسبتاً خوبی برای حل مسئله بهینه سازی پرتفوی با مؤلفه های مقید دارند. همچنین، مقایسه درصد خطایپرتفوی به دست آمده با استفاده از الگوریتمهای مزبور از خط کارای استاندارد، بیانگر خطای کم (کیفیت محاسبات) و زمانکم محاسباتی الگوریتم TS-SA و در نتیجه کارایی بیشتر آن نسبت به الگوریتم SA است

کلمات کلیدی:

الگوریتم تبرید شبیه سازی شده، الگوریتم جستجوی ممنوع، بهینه سازی پرتفوی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/549816>

