

عنوان مقاله:

بهینه سازی سبد سرمایه گذاری چند دوره ای میانگین- نیم واریانس توسط الگوریتم های بهینه سازی ملهم از اپتیک و بهینه سازی ازدحام ذرات

محل انتشار:

سومین کنفرانس نوآوری های اخیر در مهندسی صنایع و مهندسی مکانیک (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

نویسندگان:

پری حسین زاده - دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی صنایع-مهندسی مالی دانشگاه تربیت مدرس

فریماه مخاطب رفیعی - دانشیار دانشکده مهندسی صنایع و سیستم ها دانشگاه تربیت مدرس

خلاصه مقاله:

سبد سرمایه گذاری مجموعه ای از اوراق بهادار و دارایی های متفاوت هست. پرتفوی، سبدی از سرمایه گذاری است که توسط یک فرد سرمایه گذار سبد سهام مجموعه ای از اوراق و دارایی های متفاوت هست. سبد سهام، سبدی از سرمایه گذاری است که توسط یک فرد سرمایه گذار با یک شرکت سرمایه گذاری تشکیل می شود. مدیریت سبد سهامدربگیرنده یک سری قیمت های مناسب در رابطه با خرید و فروش سهام هست. این فرآیند دربرگیرنده مدیریت صحیح پولنیز هست. علاوه براین، مدیریت سبد سهام باعث کاهش ریسک و افزایش بازده می شود. در بهینه سازی سبد سهام، مسیله اصلی، انتخاب بهینه دارایی ها و اوراق بهاداری است که با مقدار مشخصی سرمایه تهیه کرد. در این پژوهش مساله بهینه سازی سبد سرمایه گذاری چند دوره ای مدلسازی شده است. برای انتخاب سهام مناسب از میان سهام موجود در بورس اوراق بهادار تهران از روش تاپسیس و فرآیند تحلیل سلسله مراتبی و معیارهایموردنظر از جمله میانگین بازده و واریانس بازده و نسبت قیمت به سود بهره بده شده است. دارایی های تاریخی به صورتهفتگی در سال 1394 هست. برای حل مدل از الگوریتم های فرا ابتکاری بهینه سازی ملهم از اپتیک (OIO) و بهینه سازی ازدحام ذرات (PSO) استفاده شده است. مساله بهینه سازی برای دوره های 3 و 5 هفته ای و تحت سناریوهای 2، 5، 10 تایی بررسی می شود. نتیجه پژوهش کارایی و اثربخشی مشابه دو الگوریتم را بیان می دارد.

کلمات کلیدی:

بهینه سازی پرتفوی، میانگین- نیم واریانس، الگوریتم بهینه سازی ملهم از اپتیک، الگوریتم بهینه سازی ازدحام ذرات

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/594543>

