

عنوان مقاله:

الگوریتم های فراابتکاری در بهینه سازی سبد سهام

محل انتشار:

پنجمین کنفرانس بین المللی مهندسی کامپیوتر، برق و الکترونیک (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

آفاق احسان فرد - دانشجوی کارشناسی ارشد، دانشگاه آزاد اسلامی واحد سپیدان

جواد سرور - عضو هیات علمی، دانشگاه صنعتی شیراز

احمد مصلی نژاد - عضو هیات علمی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد سپیدان

خلاصه مقاله:

مهم ترین هدف هر سرمایه گذار افزایش بازده و کاهش ریسک سرمایه گذاری است. بنابراین بهینه سازی سبد سهام از موضوعات مهم در زمینه ی سرمایه گذاری محسوب می شود که هدف آن ارایه ی روشی برای سرمایه گذاران جهت انتخاب سهام مناسب می باشد. الگوریتم های فراابتکاری، نوعی از الگوریتم های بهینه سازی هستند که جهت حل مشکل بهینه محلی راه حل هایی را ارایه داده اند و کاربردهای مختلفی دارند و بصورت گسترده ای در بهینه سازی سبد سهام مورد استفاده قرار می گیرند. در یک دسته بندی کلی می توان الگوریتم های فراابتکاری را به دو دسته الگوریتم های مبتنی بر یک جواب و الگوریتم های مبتنی بر جمعیت تقسیم کرد. الگوریتم های فراابتکاری در زمینه بهینه سازی سبد سهام با هدف افزایش بازده و کاهش ریسک ارایه شده اند. در این مقاله ابتدا به بررسی مفاهیمی که در بهینه سازی سبد سهام بکار می روند خواهیم پرداخت، سپس الگوریتم های رایج بهینه سازی تشریح و در نهایت برخی از جدیدترین الگوریتم های ارایه شده در این زمینه را معرفی می کنیم.

کلمات کلیدی:

سبد سهام، بهینه سازی، الگوریتم فرا ابتکاری، مدل میانگین-واریانس، GENETIC ALGORITHM، ALO، PDILDE

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/611441>

