

عنوان مقاله:

الگوریتم ابتکاری بهینه سازی چند دوره ای سبد سرمایه گذاری با محدودیت هزینه معاملات مبتنی بر بازدهی موثر

محل انتشار:

دومین کنفرانس بین المللی مدیریت، حسابداری و اقتصاد (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

نویسندگان:

زهرا پوراحمدی - کارشناس ارشد مهندسی مالی دانشگاه خواجه نصیرالدین طوسی

امیرعباس نجفی - استادیار دانشکده صنایع دانشگاه خواجه نصیرالدین طوسی

خلاصه مقاله:

اهمیت بحث سرمایه گذاری، که به منظور حفظ ارزش و کسب بازده از دارایی ها، مورد استفاده سرمایه گذاران قرار می گیرد، بر کسی پوشیده نیست. در این مطالعه به ارائه الگوریتمی ابتکاری به منظور بهینه سازی سبد سرمایه گذاری به صورت چند سهمی و چند دوره ایبرداخته شده است. در این الگوریتم با استفاده از انباشته بازگشتی بازدهی و آخرین زمان مناسب برای نگهداری ثروت در سهم، مطلوبیت کلی حاصل از سرمایه گذاری مشخص می شود و استراتژی مناسب ارائه می گردد. نکته اصلی در این تحقیق در نظرگیری هزینه معاملات و بهره گیری از روش بهینه سازی نوینی است که می تواند مطلوبیت سرمایه گذار را به طور چشمگیری افزایش دهد.

کلمات کلیدی:

بهینه سازی چنددوره ای، بازدهی انباشته، هزینه معاملات، سبد سرمایه گذاری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/559668>

