

Optimasi Portofolio Saham Menggunakan PSO: Pendekatan Mean-Variance Markowitz = Stock Portfolio Optimization Using PSO: Mean-Variance Approach

Marpaung, Johnson, author

Deskripsi Lengkap: <https://lib.ui.ac.id/detail?id=9999920534566&lokasi=lokal>

Abstrak

Dalam penelitian ini akan ditunjukkan aplikasi permasalahan pembentukan portofolio berdasarkan model mean-variance Markowitz. Penambahan kendala minimal lot transaksi pada model Markowitz merubah permasalahan ini menjadi bentuk mixed-integer non linear programming yang teramat sulit untuk dicari solusinya menggunakan pendekatan optimasi klasik. Untuk itu akan ditunjukkan alternatif penyelesaian menggunakan metode komputasi berbasis heuristic, yaitu PSO. Dengan penentuan nilai parameter yang tepat, algoritma PSO dapat secara konvergen menemukan solusi untuk permasalahan ini.

.....We will show in this paper application of portfolio selection problem based on Markowitz's mean-variance model. The inclusion of minimum transaction lot turn the standard model into a mixed-integer non linear programming which is very hard to be solved using classical optimization method. We will show an alternative heuristic based approach, PSO to tack this problem. With the appropriate parameter PSO can find a good solution to this problem