



بخشی از ترجمه مقاله

عنوان فارسی مقاله :

حداکثرسازی و حداقل سازی تمرکز سرمایه‌گذاری با محدودیت‌های بودجه و ریسک سرمایه‌گذاری

عنوان انگلیسی مقاله :

Maximizing and minimizing investment concentration with constraints of budget and investment risk



توجه !

این فایل تنها قسمتی از ترجمه میباشد. برای تهیه مقاله ترجمه شده کامل با فرمت ورد (قابل ویرایش) همراه با نسخه انگلیسی مقاله، [اینجا](#) کلیک نمایید.



بخشی از ترجمه مقاله

5. Conclusion and Future work

In the present study, we used replica analysis, which was developed for cross-disciplinary research, to analyze the duality problem of the portfolio optimization problem with several constraint conditions, which has been considered in our previous studies [11, 12, 13, 14, 15, 16]. We determined a feasible portfolio that maximizes the investment concentration subject to budget and risk constraints, and one that minimizes the investment concentration. We applied a canonical ensemble analysis to a large, complicated system with respect to this optimization problem with several restrictions. From a unified viewpoint, we were able to derive the maximum and minimum investment concentrations from the subset of feasible portfolios. The portfolio optimization problem considered in this paper is the dual of the optimization problem discussed in our previous study [16], and we verified that the optimal solutions possess the duality structure. In the numerical experiments, we used the method of steepest descent that is based on Lagrange's method of undetermined multipliers, and we compared the numerical and theoretical results to verify our proposed approach.

5. نتیجه‌گیری و کارهای آینده

ما در مطالعه حاضر، از آنالیز تکرار استفاده کردیم که برای تحقیقات میانرشته‌ای به منظور آنالیز مسئله دوگانگی بهینه‌سازی پورتفولیو با شرایط محدود متعدد ایجاد شد و در مطالعات قبل (11, 12, 13, 14, 15, 16) مذکور قرار گرفت. همچنین یک پورتفولیوی قابل اجرا را که گمرک سرمایه‌گذاری مستعد محدودیت‌های رسیک و بودجه را به حد اکثر می‌رساند و همچنین یک پورتفولیوی که گمرک سرمایه‌گذاری را به حداقل می‌رساند، تعیین کردیم. ما از تحلیل تناظر کانونی برای یک سیستم بزرگ و پیچیده با توجه به این مسئله بهینه‌سازی با محدودیت‌های مختلف استفاده کردیم. از یک چشم‌انداز یکپارچه، قادر بودیم تا حد اکثر و حداقل گمرک سرمایه‌گذاری را از زیرمجموعه پورتفولیوهای قابل اجرا استنتاج کنیم. مسئله بهینه‌سازی پورتفولیوی مورد نظر در این مقاله، یک مسئله بهینه‌سازی دوگانه است که در مطالعه قبل مورد بحث قرار گرفت (16)، و ما تأیید کردیم که راه حل‌های بهینه دارای ساختار دوگانه‌ای هستند. در آزمایشات عددی از روش تدترين نزول استفاده شد که بر مبنای روش لاگرانژ از ضرایب نامعلوم است و ما نتایج نظری و عددی را برای تأیید رویکرد پیشنهادی خود مورد مقایسه قرار دادیم.



توجه !

این فایل تنها قسمتی از ترجمه میباشد. برای تهیه مقاله ترجمه شده کامل با فرمت

ورد (قابل ویرایش) همراه با نسخه انگلیسی مقاله، [اینجا](#) کلیک نمایید.

برای جستجوی جدیدترین مقالات ترجمه شده، [اینجا](#) کلیک نمایید.