

DOĞRUSAL OLMAYAN OPTİMİZASYON MODELLERİNİN PORTFÖY YÖNETİMİNDE KULLANILMASI

Zülal GÜNGÖR

Endüstri Mühendisliği Bölümü, Mühendislik-Mimarlık Fakültesi, Gazi Üniversitesi
Maltepe 06570 Ankara

ÖZET

Doğrusal Olmayan Programlama teorisi ve tekniklerinin en önemli uygulama alanlarından birisi de finans, ekonomi sigortacılık ve bankacılık alanlarından birisi olan portföy analizidir. Bu alanda yapılan çalışmalar teorik olduğu kadar uygulamaya da yöneliktir. Portföy seçimi modellerini riski minimize ederek veya portföy yatırımından elde edeceğimiz gelirin faydasını maksimum yaparak kurabiliriz.

Anahtar Kelimeler: Portföy yönetimi, doğrusal olmayan optimizasyon

APPLICATION OF NONLINEAR PROGRAMMING TECHNIQUES IN PORTFOLIO MANAGEMENT

ABSTRACT

A major area of application of nonlinear optimization theory and techniques is that of portfolio analysis in the fields of finance economics, insurance and banking. The work done in these areas has been of theoretical as well as an applied nature. Portfolio selection modals can be constructed by minimizing the risk or maximizing the utility gained from per unit of money invested in the portfolio.

Keywords: Portfolio management, nonlinear optimization