



## 基于PSO的考虑完整费用的证券组合优化研究

<http://www.firstlight.cn> 2010-09-01

通过分析中国证券市场证券交易不可拆分、不能卖空的特点以及现存的各种交易费用，建立一个考虑完整交易费用的证券投资组合优化模型，同时给出一个应用粒子群算法(PSO)求解的实例。结果证明该证券投资组合优化模型的完整性和有效性，也表明PSO算法可以快速准确地求解证券投资组合优化问题。

[存档文本](#)