

典型应用(Typical applications)

机会约束下贷款组合优化决策的方差最小化模型

宁玉富¹;唐万生²;严维真²

德州学院计算机系¹

天津大学²

收稿日期 2007-11-9 修回日期 2008-2-6 网络版发布日期 2008-5-7 接受日期

摘要 通过把贷款的收益率刻画为模糊变量,提出了机会约束下贷款组合优化决策的方差最小化模型。针对贷款收益率是特殊的三角模糊变量的情况,给出模型的清晰等价类,对等价类模型用传统的方法进行求解。对于贷款收益率的隶属函数比较复杂的情况,应用集成模糊模拟、神经网络、遗传算法和同步扰动随机逼近算法的混合优化算法求解模型。数值算例验证了模型和算法的有效性。

关键词 [贷款组合](#) [机会约束](#) [方差最小化模型](#) [模糊变量](#) [模糊模拟](#) [遗传算法](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [A7116157](#)

通讯作者:

宁玉富 ning@tju.edu.cn; yufuning@163.com

作者个人主页: 宁玉富 唐万生 严维真

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF \(646KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [参考文献\[PDF\]](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [引用本文](#)
- ▶ [Email Alert](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“贷款组合”的 相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

- [宁玉富](#)
- [唐万生](#)
- [严维真](#)