

最小コストリバランスを用いたインデックスファンドの最適化

システムデザイン研究科経営システムデザイン専修 博士前期過程1年
杉崎 翔大、山本 久志 クォリティマネジメント研究室
E-mail shota-sugizaki@sd.tmu.ac.jp



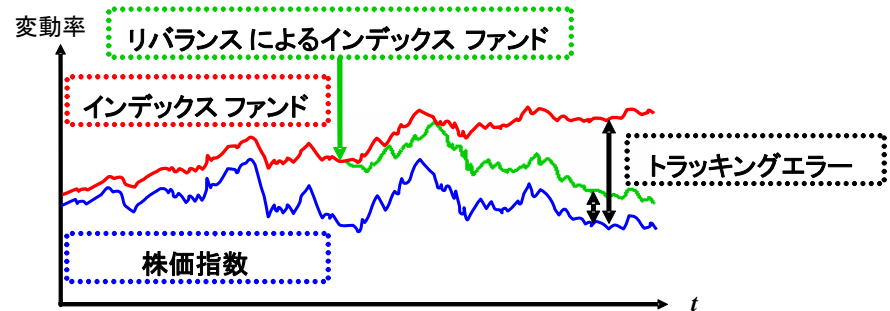
<概要>

1. インデックスファンドの作成
2. リバランス手法の提案
3. 売買代金を基にしたコストの作成
4. GAを用いた組み合わせ最適解探索
5. ペナルティ関数を用いた目的関数の設定
6. TOPIXのデータを用いたファンドの評価

インデックスファンドとリバランス

インデックスファンド: 株価指数と連動するように作成された投資信託

リバランス: ファンドの目的にあわせ、構成する銘柄の投資比率 を組み換えること



目的: リバランスのための最適化問題を解く