

Optimizare folosind PSO

Sun et al. (2011) propun un algoritm PSO modificat.

Întrebări

1. Descrieți algoritmul PSO. Care este modificarea propusă de Sun et al. (2011)? Care sunt avantajele așteptate? Descrieți problema de optimizare a portofoliului. Ce alte metode au fost folosite în literatură pentru această problemă? Descrieți cel puțin 2 metode.
2. Implementați metoda PSO și aplicați metoda pe un exercițiu de laborator. Cum se compară rezultatele cu cele obținute la laborator?

Bibliografie

Sun, J., Fang, W., Wua, X., Lai, C.-H., and Xu, W. (2011). Solving the multi-stage portfolio optimization problem with a novel particle swarm optimization. *Expert Systems with Applications*, 38:6727–6735.