

Resolución de un modelo de Programación por Metas Difusa Incompatible: Aplicación a la selección de carteras.

Grupo de Decisión Multicriterio Universidad de Oviedo (MCDMUO).

Universidad de Oviedo.

Abstract: En este trabajo abordamos el problema de la infactibilidad en los modelos de Programación por Metas Difusa con umbrales de tolerancia incompatibles. Proponemos una formulación algebraica alternativa para las funciones de pertenencia que representan la satisfacción de las metas. Con estas nuevas expresiones analíticas para las metas y una función de logro combinación lineal convexa de la satisfacción en el cumplimiento de las metas y la suma ponderada de las desviaciones no deseadas se obtienen modelos factibles en todos los casos. Por tanto, este enfoque es un híbrido entre la Programación por Metas Difusa y la Programación por Metas Estándar conservando las buenas propiedades de ambas. La metodología permite el tratamiento simultáneo de metas difusas y estándar. El método propuesto se aplica a un problema de selección de carteras socialmente responsables.

Palabras Clave: Programación por Metas Difusa; Programación por Metas Estándar; Función de Pertenencia; Infactibilidad; Inversión Socialmente Responsable; Selección de Carteras.