

عنوان مقاله:

شناسایی استراتژی معاملاتی بهینه در بورس اوراق بهادار، با استفاده از برنامه ریزی پویا

محل انتشار:

فصلنامه تصمیم گیری و تحقیق در عملیات، دوره 6، شماره 4 (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

فاطمه یزدانی - گروه مهندسی صنایع و سیستم ها، دانشگاه صنعتی اصفهان، اصفهان، ایران.

مهدی خاشعی - گروه مهندسی صنایع و سیستم ها، دانشگاه صنعتی اصفهان، اصفهان، ایران.

سید رضا حجازی - گروه مهندسی صنایع و سیستم ها، دانشگاه صنعتی اصفهان، اصفهان، ایران.

خلاصه مقاله:

هدف: این مقاله، در راستای ارائه مدلی برای شناسایی سودده ترین نقاط عطف و یا نقاط عطف بهینه موجود در گذشته سری زمانی ابزار مالی، تدوین گردیده است. استراتژی معاملاتی سودده که به عنوان ابزاری برای کسب سود در بورس شناخته می شود، استراتژی ای است که از نقاط معاملاتی سودده، شکل گرفته شده باشد. نقاط معاملاتی، در ادبیات موضوع با نام نقاط عطف شناخته می شوند. پیش بینی نقاط عطف ابزاری برای دستیابی به استراتژی معاملاتی سودده می باشد. اولین گام برای پیش بینی نقاط عطف، شناسایی نقاط عطف موجود در گذشته سری زمانی ابزار مالی است. میزان سوددهی نقاط عطف شناسایی شده، تاثیری مستقیم بر میزان سوددهی نقاط عطف پیش بینی شده می گذارد. به همین دلیل ادبیات موضوع، همواره در تلاش برای افزایش میزان سوددهی نقاط عطف مالی شناسایی شده، بوده است. بررسی کامل ادبیات موضوع توسط محققین نشان می دهد که هیچ یک از روش های موجود، قابلیت شناسایی سودده ترین نقاط عطف مالی را ندارند. روش شناسی پژوهش: این مقاله، مسئله شناسایی نقاط عطف سری زمانی ابزارهای مالی را در بستر برنامه ریزی پویا مدل سازی می کند و پس از آن با استفاده از فرآیندی بازگشتی، به حل بهینه آن می پردازد. یافته: نتایج عددی حاصل از پیاده سازی مدل شناسایی پیشنهادی بر چهار شرکت فعال در بورس اوراق بهادار تهران، نشان می دهد که این مدل، از قابلیت شناسایی نقاط عطف بهینه مالی برخوردار است. اصالت/ارزش افزوده علمی: مقایسه عملکرد مدل پیشنهادی با تعدادی از بهترین روش های شناسایی موجود در ادبیات موضوع، نشان دهنده کارایی مدل پیشنهادی در مسئله شناسایی نقاط عطف مالی است.

کلمات کلیدی:

ابزار مالی، استراتژی معاملاتی، برنامه ریزی پویا، شناسایی نقاط عطف

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1312945>

