

عنوان مقاله:

بررسی و تعیین پرتفوی بهینه سهام شرکتهای فعال صنایع غذایی بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد و توسعه کشاورزی، دوره 24، شماره 3 (سال: 1389)

تعداد صفحات اصل مقاله: 6

نویسندگان:

ابوالفضل قدیری مقدم

هادی رفیعی دارانی

خلاصه مقاله:

چکیده تشکیل پرتفوی بهینه از جمله مهمترین و حیاتی ترین تصمیمات افراد حقیقی و حقوقی سرمایه گذار در بورس اوراق بهادار می باشد. هدف اصلی این مطالعه، تعیین و بررسی پرتفوی بهینه در خصوص سهام شرکتهای فعال صنایع غذایی بورس اوراق بهادار تهران بر اساس شاخص ارزش در معرض ریسک $VaR(3)$ می باشد. برای دستیابی به اهداف مورد نظر، از آمار هفتگی سهام شرکتهای فعال صنایع غذایی بورس اوراق بهادار تهران از بهمن ماه 1387 تا تیرماه 1389 استفاده گردید. همچنین برای تحلیل آمار و اطلاعات از برنامه ریزی ریاضی با اعداد صحیح استفاده شد. نتایج نشان داد که سهام شرکتهای کشاورزی و دامپروری مگسال و سالمین در تمام پرتفوهای بهینه وجود دارند که با افزایش میزان VaR ، سهام شرکت صنعتی پارس مینو نیز به پرتفوی بهینه وارد می گردد. از دیگر نتایج قابل توجه این مطالعه، وجود ارتباط مستقیم بین میزان VaR و بازدهی انتظاری سرمایه گذاران و همچنین عدم وجود رابطه مشخص بین VaR و تنوع پرتفوی بهینه (تعداد سهام در پرتفوی) می باشد. واژه های کلیدی: پرتفوی بهینه، بورس اوراق بهادار تهران، شرکتهای صنایع مواد غذایی، شاخص ارزش در معرض ریسک (VaR)

کلمات کلیدی:

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1355012>

