

عنوان مقاله:

گزینش بهترین شرکت های بازار سرمایه جهت سرمایه گذاری با استفاده از روش جهش قورباغه

محل انتشار:

فصلنامه اکتشاف و پردازش هوشمند دانش، دوره 1، شماره 3 (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 18

نویسندگان:

روح الله رحمانی - مربی گروه حسابداری، موسسه آموزش عالی فردوس، مشهد، ایران

رضا غلامی - دانش آموخته کارشناسی ارشد حسابداری، موسسه آموزش عالی فردوس، مشهد، ایران

سید جواد حبیب زاده بایگی - استادیار گروه حسابداری، موسسه آموزش عالی فردوس، مشهد، ایران

خلاصه مقاله:

فرآیند انتخاب پرتفوی سهام جهت سرمایه گذاری یکی از مسائلی است که موردتوجه محققین زیادی بوده است. در تصمیم گیری به منظور سرمایه گذاری، دو عامل از اهمیت بسزایی برخوردار بوده و مبنای سرمایه گذاری می باشد. این دو عامل ریسک و بازده هستند و در این رابطه، بررسی و مطالعه سرمایه گذاران در جهت انتخاب بهترین سبد سرمایه گذاری با توجه به میزان ریسک و بازده آن انجام می شود. هدف این تحقیق ایجاد مدلی هوشمند جهت انتخاب سبد بهینه سهام با استفاده از الگوریتم های تحقیق می باشد. مدل پیشنهادی، انواع مختلف سرمایه گذاری هایی را بررسی میکند که یک سرمایه گذار می تواند و تمایل دارد جهت تشکیل سبد سرمایه گذاری خود، آن ها را مورد ملاحظه قرار دهد. به این منظور، ریسک و بازده مورد انتظار شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران به صورت ماهیانه موردبررسی قرارگرفته است. نمونه آماری تحقیق شامل داده های مالی ۲۳۷ شرکت بورس ایران طی سال های ۱۳۹۰ تا ۱۳۹۸ می باشد. نتایج تحقیق نشان می دهد که الگوریتم LISFLA قادر به انتخاب پرتفو با استفاده از مدل مارکوییز برای سرمایه گذار ریسک پذیر و ریسک گریز است.

کلمات کلیدی:

سبد سهام، ریسک، بازده، الگوریتم قورباغه، ریسک پذیری، احتیاط سرمایه گذار

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1422422>

