

عنوان مقاله:

تمرکز سرمایه گذاری با ریسک سرمایه گذاری

محل انتشار:

پانزدهمین کنفرانس بین المللی مدیریت، اقتصاد و توسعه (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

امیرعباس آجری ایسک - دانشکده اقتصاد، دانشگاه فردوسی مشهد، مشهد، ایران

محمدطاهر احمدی شادمهری - دانشکده اقتصاد، دانشگاه فردوسی مشهد، مشهد، ایران

خلاصه مقاله:

در این مقاله، ما به عنوان اولین قدم در بررسی ویژگی های یک زیرمجموعه پورتفولیوی قابل اجرا که با محدودیتهای ریسک و بودجه شناخته میشود، به ارزیابی حداکثر و حداقل تمرکز سرمایه گذاری با استفاده از آنالیز تکرار (ریلیکا) میپردازیم. برای انجام این کار، ما از یک رویکرد تحلیلی مکانیک آماری استفاده میکنیم و درمی یابیم که مسئله بهینه سازی موردنظر در این مقاله یک مسئله دوجانبه از مسئله بهینه سازی پورتفولیو است که در نشریات مورد بحث قرار گرفته و ما تایید میکنیم که این راه حلهای بهینه نیز دوجانبه هستند. ما همچنین آزمایشات عددی را ارائه میدهم بطوریکه از روش تندترین نزول که برای مبنای روش ضرایب نامعلوم لاگرانژ است استفاده میکنیم و نتایج عددی را با نتایج به دست آمده از آنالیز تکرار مورد مقایسه قرار میدهم تا کارایی رویکرد پیشنهادی خود را ارزیابی کنیم.

کلمات کلیدی:

بهینه سازی پورتفولیو، آنالیز تکرار، ریسک سرمایه گذاری، تمرکز سرمایه گذاری.

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1573240>

