

عنوان مقاله:

بکارگیری مدل میانگین- واریانس مبتنی بر اعتبار برای تشکیل سبدی از صندوق های سرمایه گذاری مشترک

محل انتشار:

مجله مدل سازی پیشرفته ریاضی، دوره 4، شماره 2 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 22

نویسندگان:

مهسا صمند - گروه مدیریت، دانشگاه شهید چمران اهواز

حسنعلی سینایی - گروه مدیریت، دانشگاه شهید چمران اهواز

خلاصه مقاله:

تحقیق حاضر، به بررسی مسئله بهینه سازی پرتفوی (به عنوان یکی از مسائل بنیادین در حوزه ی سرمایه گذاری) با توجه به مفاهیم ریسک مبتنی بر تئوری اعتبار می پردازد. به نحوی که، مدل بهینه سازی پرتفوی در چارچوب تئوری امکان (زاده ۱۹۶۵-۱۹۷۸ میلادی) را با یک مدل بهینه سازی پرتفوی نوین مبتنی بر تئوری احتمال منطبق ساخته و مدل اخیر را که در واقع در قالب یک رویکرد سرمایه گذاری منفعلانه مطرح میگردد، پیرامون تشکیل سبدی از صندوق های سرمایه گذاری سهامی فعال در بورس اوراق بهادار تهران از سال ۱۳۹۰ تا پایان دی ماه سال ۱۳۹۲ مورد بررسی قرار میدهد. نتایج حاصل از اجرای رویکرد مزبور بوسیله کاربرد الگوریتم ژنتیک، حاکی از عملکرد مشابه سبد تشکیل شده از صندوقها (بر مبنای شاخص شارپ) با عملکرد بازارست.

کلمات کلیدی:

صندوق های سرمایه گذاری، تئوری اعتبار، تئوری امکان، الگوریتم ژنتیک

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1827570>

