

عنوان مقاله:

بهینه سازی سبد سرمایه گذاری

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی حقوق ، مدیریت ، علوم تربیتی ، روانشناسی و مدیریت برنامه ریزی آموزشی (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

رحمان رحیمی - استاد مدعو گروه حسابداری، واحد تهران جنوب، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

مونا وقاری - دانشجوی کارشناسی حسابداری، واحد تهران جنوب، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

بهینه سازی پرتفوی چیزی نیست جز فرآیندی که در آن سرمایه گذار راهنمایی درستی را در مورد انتخابداری ها از طیف گزینه های دیگر دریافت میکند و در این نظریه پروژه ها / برنامه ها بر مبنای فردی ارزشگذاری نمیشوند بلکه به عنوان بخشی از یک پرتفوی خاص ارزش گذاری میشود. بهینه سازی پرتفوی روشی برای انتخاب پرتفوی است که سودآور ترین نرخ بازده را برای هر واحد ریسک پذیرفته شده توسط سرمایه گذاران برمی گرداند. پرتفولیو توزیع دارایی یا به عبارت دیگر مجموعه گزینه های سرمایه گذاری یک سرمایه گذار است . بهترین پرتفوی برای یک سرمایه گذار به گزینه های مختلفی مانند ریسک پذیری، نرخ بازده مورد انتظار و سایر کاهش هزینه ها بستگی دارد. هدف از انجام این تحقیق نگاهی جامع به بهینه سازی پرتفولیو و آشنایی با مفاهیم آن است.

کلمات کلیدی:

پرتفولیو ، بهینه سازی ، ریسک ، بازده ، دارایی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1876805>

