

## عنوان مقاله:

بهینه سازی سبد سهام با رویکرد میانگین-نیم واریانس مبتنی بر پیش بینی با استفاده از شبکه های عصبی مصنوعی

## محل انتشار:

دومین کنفرانس ملی حسابداری، مدیریت مالی و سرمایه گذاری (سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 18

## نویسندگان:

عطیه رنگین کمان - دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی صنایع، سیستم های اقتصادی و اجتماعی دانشگاه

عباس صمدی - استادیار گروه مهندسی صنایع، دانشگاه بوعلی سینا

## خلاصه مقاله:

مسئله انتخاب بهینه سبد سهام یکی از مباحث روز حوزه مالی به شمار میرود. سرمایه گذاران فعال در بازار بورس به دنبال بیشینه کردن سود سبد و نیز کمینه کردن ریسک نامطلوب آن می باشند. مدل میانگین-نیم واریانسکه توسط مارکوویتز معرفی شده است یکی از مدل هایی است که در زمینه بهینه سازی سبد سهام بسیار مورد استفاده قرار میگیرد. تابع هدف این مدل، ترکیبی از ریسک و بازده سبد است. در این پژوهش به بهینه سازی سبد سهام با رویکرد مدل میانگین-نیم واریانس مبتنی بر پیش بینی بازده سهام پرداخته شده است. از شبکه های عصبی مصنوعی به منظور پیش بینی بازده سهام استفاده گردیده است. خروجی شبکه به عنوان ورودی به مسئله بهینه سازی وارد میشود. نتایج حاصل از بهینه سازی دو سبد، که سبد اول با استفاده از میانگین بازده های تاریخی و سبد دوم با استفاده از بازده های پیش بینی شده توسط شبکه عصبی با یکدیگر مقایسه شده اند.

## کلمات کلیدی:

بهینه سازی سبد سهام، مدل میانگین، نیم واریانس، شبکه عصبی، بورس اوراق بهادار تهران

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/254069>

