

## عنوان مقاله:

ریسک‌گریزی سرمایه‌گذارانتخاب بهینه سبد سهام با استفاده از الگوریتم ژنتیک

## محل انتشار:

همایش بین‌المللی مدیریت (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 21

## نویسندگان:

مریم فاخری نیا - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت مالی دانشگاه آزاد اسلامی واحد شوشتر

منصور زراءنژاد - استاد دانشکده اقتصاد دانشگاه شهید چمران اهواز

رضا یوسفی - استادیار گروه اقتصاد دانشگاه پیام نور

## خلاصه مقاله:

انتخاب سبد سهام در بازارهای مالی به منظور حداکثرسازی بازده (سود) یکی از مهمترین دغدغه‌های سرمایه‌گذاران در بازارهای مالی است. سرمایه‌گذار در مقابل سرمایه محدود خود انتخاب‌های نامحدودی دارد. و توجه به ریسک از مهمترین عوامل موثر بر تصمیم‌گیری اوست. هدف تحقیق حاضر انتخاب سبد سهام بهینه با توجه به عامل ریسک‌گریزی مشتری با استفاده از الگوریتم ژنتیک است. برای این منظور، اطلاعات مالی شرکت‌های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار ایران، طی سال‌های 1386 تا 1391 جمع‌آوری و با استفاده از الگوریتم ابتکاری ژنتیک و براساس مدل میانگین-واریانس مارکوویتز، و ریسک مشتری است. در مجموع نتایج این تحقیق نشان می‌دهد که استفاده از این الگوریتم، می‌تواند جواب‌هایی نزدیک به هم و نیز نزدیک به بهینگی ایجاد نموده و سبب اطمینان تصمیم سرمایه‌گذاران شود.

## کلمات کلیدی:

انتخاب سبد سهام- مدل میانگین-واریانس مارکوویتز- مدل ریسک مشتری- الگوریتم ژنتیک

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/343563>

