

عنوان مقاله:

استفاده از روش برنامه ریزی آرمانی چند انتخابی در انتخاب پورتفولیوی سهام

محل انتشار:

همایش سراسری مباحث کلیدی در علوم مدیریت و حسابداری (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 11

نویسندگان:

علیرضا دهقان - دانشجوی کارشناسی ارشد، گروه مدیریت صنعتی، دانشکده مدیریت، دانشگاه تهران، ایران

میر سید محمد محسن امامت - دانشجوی کارشناسی ارشد، گروه مدیریت صنعتی، دانشکده مدیریت، دانشگاه تهران، ایران

خلاصه مقاله:

امروزه توسعه سرمایه‌گذاری یکی از مهمترین مسائل حوزه مالی به حساب می‌آید؛ چراکه باعث هدایت سرمایه‌های ناکارا به بخشهای مولد اقتصادی کشور میگردد. از اینرو مطالعات سرمایه‌گذاری، توجه ویژه پژوهشگران علوم مختلف، از جمله پژوهشگران علم تحقیق در عملیات را به خود جلب کرده است. یکی از مهمترین و تخصصیترین مسائل حوزه سرمایه‌گذاری، انتخاب پورتفولیوی بهینه سهام میباشد. مدل‌های برنامه‌ریزی آرمانی از جمله مهمترین و موثرترین ابزارهای تحقیق در عملیات در انتخاب پورتفولیوی سهام محسوب میشوند، لذا در این پژوهش با استفاده از مدل برنامه‌ریزی آرمانی چندانتخابی، و با انتخاب 20 شرکت فعال در بورس اوراق بهادار تهران، در بازه زمانی 1392/11/10 تا 1393/11/10 پورتفولیوی سهام تشکیل شده است. پژوهش حاضر از سه معیار بازده، ریسک و نقدینگی استفاده نموده است. نتایج نشان میدهد از بین شرکتهای انتخابی تخصیص بهینه سرمایه زمانی انجام میشود که به هر یک از سهامهای بانک انصار، بانک صادرات، پتروشیمی کرمانشاه، داروسازی جابر بن حیان و سرمایه گذاری دارویی تأمین، به میزان 20 % از کل سرمایه، تخصیص یابد

کلمات کلیدی:

تصمیم گیری چند معیاره، برنامه‌ریزی آرمانی، برنامه‌ریزی آرمانی چند انتخابی، انتخاب پورتفولیوی سهام، بورس اوراق بهادار، سرمایه‌گذاری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/374652>

