

عنوان مقاله:

کمینه کردن خطای ردیابی شاخص بر اساس تکنیک جداسازی کورمنابع

محل انتشار:

کنفرانس بین المللی پژوهشهای نوین در مدیریت و مهندسی صنایع (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

بهاره دادگر - کارشناسی ارشد رشته مهندسی مالی، دانشکده صنایع دانشگاه صنعتی امیرکبیر

سید میلاد رضوانی زانیانی - کارشناسی ارشد رشته مهندسی مالی، دانشکده صنایع دانشگاه صنعتی امیرکبیر

پژمان مهران - استادیار، دانشکده صنایع دانشگاه صنعتی امیرکبیر

خلاصه مقاله:

مساله ردیابی شاخص شامل تشکیل یک سبد سرمایه گذاری برای بدست آوردن بازدهی مشابه بازده بازار (شاخص بازار) می باشد. در این پژوهش با فرض این که بازده قیمت سهم ها از تعدادی متغیر پنهان تشکیل شده، با استفاده از آنالیز مولفه های مستقل که یکی از روش های جداسازی کورمنابع به شمار می آید، به تخمین این متغیرهای پنهان پرداخته شده است. بر اساس متغیرهای پنهان تخمینی، معیار به عنوان جفت اطلاعاتی برای اندازه گیری شباهت بین سهم ها ارائه و به منظور انتخاب تعداد معدودی سهم برای سبد سرمایه گذاری ردیابی شاخص، درخت پوشای کمینه ای بر مبنای این معیار بر شاخص S&P500 پیاده سازی گردیده است. برای ارزیابی عملکرد معیار جفت اطلاعاتی، مجموعه ای از سهم ها بر مبنای معیار همبستگی خطی نیز انتخاب و با استفاده از رگرسیون بردار پشتیبان دو گروه سهم های انتخابی به گونه ای که دارای کمترین ریسک عملیاتی باشند، وزن دهی شده اند. در نهایت با مقایسه نتایج خواهیم دید که سهم های انتخابی بر مبنای جفت اطلاعاتی دارای عملکرد بهتری نسبت سهم های انتخابی بر مبنای ضریب همبستگی خطی برای تشکیل سبد سرمایه گذاری ردیابی شاخص می باشد

کلمات کلیدی:

ردیابی شاخص بازار، آنالیز مولفه های مستقل، رگرسیون بردار پشتیبان

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/435083>

