

عنوان مقاله:

تشکیل پرتفوی بهینه با استفاده از الگوریتم ژنتیک و مدل تک شاخصی شارپ و مقایسه عملکرد آنها

محل انتشار:

کنفرانس بین المللی جهت گیری های نوین در مدیریت، اقتصاد و حسابداری (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

فاطمه کریمی - کارشناسی ارشد دانشگاه آزاد اسلامی واحد بیرجند گروه حسابداری

سید محمود موسوی شیری - استادیار دانشگاه پیام نور مشهد گروه حسابداری

خلاصه مقاله:

این مقاله، به بررسی ارتباط بین نسبت های مالی با بازده سهام شرکت ها در بورس اوراق بهادار تهران پرداخته است. فرضیه های تحقیق از طریق روش های آماری رگرسیون سری زمانی و بهینه سازی پرتفوی از روش الگوریتم ژنتیک مورد آزمون قرار گرفته است. نتایج تحقیق نشان می دهد که بین اطلاعات حسابداری با بازده سهام نیز فقط در 4 مورد دارای همبستگی است. این موضوع نشان می دهد که در ایران اطلاعات تاریخی حسابداری به طور کامل در قیمت اوراق بهادار انعکاس نمیابند. به بیان دیگر بورس اوراق بهادار تهران، از کارایی لازم برخوردار نیست. در بخش دوم تحقیق با استفاده از اطلاعات نسبت شارپ نیز اقدام به تشکیل پرتفوی بهینه گردید. در نهایت با استفاده از معیار عملکرد ترینر پرتفوی ها با هم مقایسه شد. نتایج عملکرد پرتفوی ها نشان دهنده بهینه بودن پرتفوی تشکیل شده توسط معیار شارپ بود. به بیان دیگر بورس اوراق بهادار تهران، از کارایی لازم برخوردار نیست

کلمات کلیدی:

الگوریتم ژنتیک، پرتفوی، نسبت های مالی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/454573>

