

عنوان مقاله:

طراحی مدل بهینه سازی پرتفولیو با استفاده از برنامه ریزی ریاضی فازی (مورد کاوی: شرکت سرمایه گذاری بانک صادرات ایران)

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی حماسه سیاسی (با رویکردی بر تحولات خاورمیانه) و حماسه اقتصادی (با رویکردی بر مدیریت و حسابداری) (سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

نویسندگان:

محمد نصراللهی - استادیار، دانشکده علوم انسانی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد بابل

مهرداد حسین زاده - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت بازرگانی-بین الملل، دانشکده علوم انسانی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد بابل

افشین ایمانی - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت بازرگانی-بین الملل، دانشکده علوم انسانی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد بابل

مرتضی ولی اله پور - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت بازرگانی-بین الملل، دانشکده علوم انسانی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد بابل

خلاصه مقاله:

مساله بهینه سازی همواره مد نظر بشر بوده است و او را بر آن داشته است که با توجه به محدودیت منابع در دسترس، به دنبال راهی باشد که بیشترین مزیت را برای او ایجاد کند و او را در تصمیمات پیشرو یاری نماید. در این تحقیق مساله بهینه سازی پرتفوی، با توجه به اهمیت آن در بورس به عنوان محور اصلی نظام مالی هر کشور و نقش آن در تخ بهینه منابع، از یک طرف، و برای سرمایه گذاران که خواهان بازده بیشتر و ریسک مورد انتظار کمتری هستند، از طرف دیگر، مورد بررسی قرار می گیرد. سپس یک مدل در شرایط فازی به نحوی طراحی می شود که ضمن به حداقل رساندن ریسک، حداکثر بازده مورد انتظار را برای سرمایه گذاران به ارمغان بیاورد، در این راه از روشهای تصمیم گیری چند هدفه (MODM) کمک گرفته می شود. در این پژوهش پس از مدل سازی، به عنوان موردکاوی، پرتفوی بورسی شرکت رمایه گذاری بانک صادرات مورد بررسی قرار می گیرد.

کلمات کلیدی:

سبد سهام- منطق فازی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/495736>

