

عنوان مقاله:

ارائه یک مدل ریاضی برای پیش بینی اندازه ریسک سرمایه گذاری در سبد سرمایه گذاری نیروگاه های برق

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: 10

نویسندگان:

سید علی نبوی چاشمی - دکتر مدیریت مالی هیئت مدیرت دانشگاه آزاد اسلامی واحد بابل

عاطفه حسنی - کارشناسی ارشد مدیریت مدیرت مالی دانشگاه آزاد اسلامی واحد بابل

خلاصه مقاله:

یکی از مباحث مهم در جنبه های اقتصادی و اجتماعی صنعت برق موضوع خصوصی سازی می باشد. مقوله خصوصی سازی نیروگاه های تولید برق در این ارتباط از اهمیت ویژه ای برخوردار بوده و در حال حاضر با تأکیدی که بر اجرای اصل 44 قانون اساسی در کشور و به ویژه در صنعت برق می شود حضور موثر و سازنده بخش های غیردولتی نیز در این صنعت مسلماً مد نظر قرار خواهد گرفت و زمینه برای ورود سرمایه گذاران خصوصی در بخش نیروگاهی به بازار سرمایه فراهم می شود. با توجه به اینکه یکی از اصول مهم سرمایه گذاری در بازار سرمایه، انتخاب سبد سهام مطلوب با توجه به ریسک این انتخاب می باشد و سرمایه گذاران علاقمندند که با پذیرش سطح مشخصی از ریسک به بازده مورد انتظار خود دست یابند. لذا در این مقاله، سعی می شود به ارائه یک مدل ریاضی، برای پیش بینی اندازه ریسک سرمایه گذاری در سبد سهام نیروگاه های برق که به بازار سرمایه داخل خواهند شد تحت سنجه ریسک انحراف مطلق 1 پرداخته شود. خروجی این مدل می تواند به عنوان یک سیستم اطلاعاتی قدرتمند، مدیران ارشد و سرمایه گذاران در صنعت نیروگاهی را برای تصمیم گیری بهتر و مدیریت سرمایه گذاری کارآمدتر برای انتخاب سبد سهام مطلوب یاری رساند.

کلمات کلیدی:

خصوصی سازی، بازار سرمایه، نیروگاه های برق، سبد سهام، سنجه ریسک

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/495850>

