

## عنوان مقاله:

بررسی تاثیر نقدینگی و قیمت سهام در تعیین پرتفوی سهام با استفاده از تحلیل پوششی داده های فازی، الگوریتم ژنتیک و انتخاب گشت تصادفی در شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران

## 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:

مریم منوچهری فر - دانشجوی کارشناسی ارشد، دانشگاه آزاد اسلامی واحد بروجرد

داریوش جاوید - مربی دانشگاه آزاد اسلامی واحد بروجرد

نسیم انصاری - دانشجوی کارشناسی ارشد، دانشگاه آزاد اسلامی واحد بروجرد

سهیلا مولوی بیستونی - دانشجوی کارشناسی ارشد، دانشگاه آزاد اسلامی واحد بروجرد

## خلاصه مقاله:

بورس اوراق بهادار تأثیر بسزایی در اقتصاد یک کشور دارد. مسأله انتخاب سهام از جمله مهمترین مسائلی که همواره مورد توجه سرمایه گذاران در بورس اوراق بهادار می باشد. به همین دلیل در این مقاله به بررسی مسأله انتخاب پرتفوی می پردازیم. جامعه آماری این پژوهش شامل تمامی شرکت های فعال در بورس اوراق بهادار تهران می باشد و همچنین نمونه آماری به روش عمدی انتخاب شده است. در این پژوهش ما به دنبال آن بودیم که مدل انتخاب پرتفوی با استفاده از تحلیل پوششی داده های فازی و الگوریتم ژنتیک در برابر انتخاب گشت تصادفی در تمامی داده ها چگونه عمل خواهد کرد. بعد از انجام محاسبات لازم نقدینگی و قیمت سهام محاسبه شد. پس از آن با استفاده از شاخص شارپ که معیار ارزیابی مجموعه سهام بود این دو مدل یعنی مدل انتخاب پرتفوی با استفاده از الگوریتم ژنتیک و مدل انتخاب گشت تصادفی مورد مقایسه قرار گرفتند و نتایج حاکی از برتری مدل انتخاب پرتفوی با استفاده از الگوریتم ژنتیک بود.

## کلمات کلیدی:

پرتفوی، تحلیل پوششی داده های فازی، الگوریتم ژنتیک، انتخاب گشت تصادفی،

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/496232>

