

عنوان مقاله:

مروری بر مدل های انتخاب سبد سهام با متغیرهای تصادفی فازی

محل انتشار:

اولین کنفرانس ملی تصمیم گیری در علوم مهندسی و مدیریت (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

نویسندگان:

عباس بابائی شلیمکی - گروه مدیریت، واحد علی آباد کتول، دانشگاه آزاد اسلامی، علی آباد کتول، ایران

حسین دیده خانی - گروه مدیریت، واحد علی آباد کتول، دانشگاه آزاد اسلامی، علی آباد کتول، ایران

خلاصه مقاله:

مساله انتخاب سبد سهام شامل پارامترهای مبهم بسیاری است و مجموعه فازی یک ابزار قدرتمند برای مقابله با عدم قطعیت مربوط به متغیرهای بازارهای مالی و رفتار سرمایه گذاران می باشد. در تصمیمگیری به منظور سرمایهگذاری، دو عامل از اهمیت بسزایی برخوردار بوده و مبنای سرمایهگذاری میباشد. این دو عامل ریسک و بازده هستند. با توجه به اینکه تخمین آتی بازده اوراق بهادار به تنهایی از طریق دادههای تاریخی نمیتواند تخمین مناسبی در جهت انتخاب پرتفوی باشد، لذا می توان از متغیر تصادفی فازی که به طور همزمان تصادفی بودن و فازی بودن متغیرها را در نظر میگیرد، برای محاسبه پارامترها استفاده کرد. بنابراین در مقاله حاضر مروری میکنیم بر بهینه سازی سبد سهام با متغیرهای تصادفی فازی و همچنین نحوه ی محاسبه متغیرهای بازده، ریسک و نقدشوندگی را بصورت تصادفی فازی نشان خواهیم داد

کلمات کلیدی:

بازده تصادفی فازی، سبد سهام، ریسک نقدشوندگی، بهینه سازی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/525241>

