

عنوان مقاله:

بررسی عملکرد مدل های الگوریتم مورچگان و تئوری خاکستری و مدل مارکویتزدر بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

همایش بین المللی افق های نوین در علوم مدیریت و حسابداری، اقتصاد و کارآفرینی (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسنده:

مهوش فرخی - دانش آموخته کارشناسی ارشد مدیریت بازرگانی- گرایش مالی دانشگاه آزاد اسلامی قزوین

خلاصه مقاله:

در پژوهش حاضر توانایی مدل های مورچگان، خاکستری و مارکویتز در انتخاب سبد سهام مورد ارزیابی قرار گرفته است، به منظور حصول این هدف 105 شرکت از میان شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران در خلال سال های 84 الی 90 مورد بررسی قرار گرفته اند که هدف از این تحقیق ارائه ی یک مدل در جهت انتخاب بهینه سهام برای سرمایه گذاران می باشد که به عنوان یک سیستم تصمیم یار (DSS) بتواند سرمایه گذاران را برای انتخاب سهام راهنمایی کند. به طورخلاصه هدف پژوهش عبارت است از: تشکیل سبد سهامی که ضمن بیشینه نمودن بازده، ریسک سرمایه گذاری را حداقل نماید. تجزیه و تحلیل ها اطلاعات و آزمون های صورت گرفته در ارتباط با فرضیه پژوهش از روش تصمیم گیری چند معیاره برای وزن دهی به شاخص های تحقیق و از تئوری خاکستری برای رتبه بندی سهام و از نرم افزار matlab ، برای تجزیه و تحلیل داده ها استفاده گردید. نتایج پژوهش نشان می دهد که مدل مبتنی بر تئوری مورچگان نسبت به دو مدل خاکستری و مدل مارکویتز دارای شکست کمتر و موفقیت بیشتر می باشد که نشان دهنده تایید فرضیه پژوهش است

کلمات کلیدی:

بورس اوراق بهادار، الگوریتم مورچه، تئوری خاکستری، مدل مارکویتز

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/567261>

