

## عنوان مقاله:

استفاده از تکنیک های تصمیم گیری چند معیاره جهت توسعه مدل مارکویتز در انتخاب سبد سهام در بورس اوراق بهادار تهران

## محل انتشار:

اولین همایش سالانه مدیریت، حسابداری و اقتصاد ایران (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 11

## نویسندگان:

سعیده طیب زاده - کارشناسی ارشد رشته مدیریت بازرگانی مالی، گروه علوم انسانی، دانشکده علوم انسانی و دانشگاه آزاد اسلامی واحد سنندج

هیرش سلطان پناه - استادیار مدیریت مالی، دکترای مدیریت، گروه علوم انسانی، دانشکده علوم انسانی و دانشگاه آزاد اسلامی سنندج

محمود رحمانی - استادیار مدیریت مالی، دکترای مدیریت، گروه علوم انسانی، دانشکده علوم انسانی و دانشگاه آزاد اسلامی

## خلاصه مقاله:

یکی از مسایل مهم در بازار سرمایه انتخاب سبدی مناسب از سهام است لذا هدف از این پژوهش، انتخاب سبد سهام با استفاده از تکنیک تصمیم گیری چند معیاره و مدل توسعه یافته مارکویتز است. بدین منظور کلیه شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار طی سال های 1392 الی 1394 به عنوان جامعه آماری لحاظ و تعداد 100 شرکت از آنها به روش غربالگری و پس از حذف مشاهدات پرت به عنوان نمونه انتخاب و مورد بررسی قرار گرفت. پژوهش حاضر از نظر راهبرد جزو تحقیقات کمی، از نظر هدف جزو تحقیقات کاربردی، از نظر روش شناسی از نوع تحقیقات پیمایشی و با توجه به توسعه مدل مارکویتز جزو تحقیقات توسعه ای می باشد. با توجه به عدم اطمینانی که در بورس اوراق بهادار تهران وجود دارد یافتن روشی که بتواند نتایج قابل قبولی برای سرمایه گذار داشته باشد اهمیت ویژه ای دارد در این تحقیق برای رسیدن به چنین هدفی ابتدا از روش تاپسیس با در نظر گرفتن مجموعه ای از شاخص ها شرکت های برتر شناسایی شده سپس از مدل توسعه یافته ی مارکویتز از میان آنها سبد مناسب انتخاب می گردد. نتایج حاصل از تجزیه و تحلیل داده ها نشان می دهد که روش ارایه شده می تواند روش مناسبی جهت انتخاب پرتفولیوی سهام باشد.

## کلمات کلیدی:

سبد سهام، مدل مارکویتز، تصمیم گیری چند معیاره، تاپسیس

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/697291>

