

عنوان مقاله:

بررسی ارزیابی سبد سهام بهینه از بین سهام شرکتهای پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

فصلنامه مطالعات مدیریت و حسابداری، دوره 2، شماره 2 (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

مهرداد قنبری - عضو هیئت علمی دانشگاه آزاد اسلامی واحد کرمانشاه

آسو بهرامی - دانشجوی دکترای دانشگاه آزاد اسلامی واحد کرمانشاه

صادق همه خانی - دانشجوی دکترای دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات

خلاصه مقاله:

این پژوهش به بررسی این موضوع میپردازد که در قیاس با رشد روزافزون استفاده از پورتنفوی ها و نیز با وجود ادبیات غنی آن، همچنان موضوعات و سوالات بیپاسخ فراوانی در این زمینه وجود دارد. همچنین بازارهای بورس ایران، به عنوان بازارهایی رو به رشد، نیازمند پژوهشهای بومی در پاسخ به این سوالات و موضوعات میباشد. هدف از این پژوهش، ارائه ی ابزاری مفید و کارا برای کمک به متخصصین و محققین، در تیوری انتخاب پورتنفوی است. پژوهش، به بررسی جامع ادبیات موضوع و پیشرفتهای و گسترش های صورت پذیرفته در زمینه ی انتخاب و بهینه سازی پورتنفوی پرداخته و از الگوریتم رقابت استعماری بر مسیله ی بهینه سازی پورتنفوی در بازار بورس اوراق بهادار تهران و از بین سهام 50 شرکت برتر استفاده میکند؛ تا سبدهایی بهینه، دارای ریسک کمینه و بازده بیشینه به طور همزمان را انتخاب نماید. همچنین، در این پژوهش، برای اثربخشی و کارایی بالاتر بازدهی ماهانه استفاده میشود که براساس فرضیه اصلی نتایج آشکار میسازند که تفاوت معناداری بین روش مارکویتز و الگوریتم رقابت استعماری وجود ندارد.

کلمات کلیدی:

بهینه سازی پورتنفوی (سبد سهام)، تیوری مدرن پورتنفوی، الگوریتم رقابت استعماری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/705422>

