

عنوان مقاله:

بهینه سازی سبدسهم به چند روش آماری

محل انتشار:

دهمین کنفرانس بین المللی انجمن تحقیق در عملیات ایران (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 8

نویسندگان:

افشین فیاض موقر - استادیار دانشگاه مازندران

میبا دهگان - دانشجوی ارشد دانشگاه مازندران

خلاصه مقاله:

سرمایه گذاران برای کسب سود بیشتر و کاهش ریسک سرمایه گذاری، به دنبال پرتفوی بهینه هستند. برای این منظور، با کمک ریاضیات و آمار مدل هایی ارایه شده است که ابتدایی ترین آنها مدل مارکوییتز می باشد. پس از مارکوییتز مدل هایی پیشنهاد شد که با اضافه کردن چولگی و آنتروپی به عنوان تابع هدف، مدل مارکوییتز را بهبود بخشیده شده است. در این مطالعه، ضمن معرفی مدل مارکوییتز، تاثیرات چولگی و آنتروپی بر انتخاب سبدسهم بهینه و عملکرد آنها در دوره های سرمایه گذاری کوتاه مدت و بلند مدت بررسی شده است. در بین مدل های ارایه شده، مدل میانگین واریانس چولگی آنتروپی با آنتروپی رنی در دوره های سرمایه گذاری بلند مدت عملکرد بهتری در تعیین سبدسهم بهینه داشت.

کلمات کلیدی:

آنتروپی، انتخاب سبدسهم بهینه، بهینه سازی، پرتفوی، چولگی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/767103>

