

عنوان مقاله:

انتخاب سبد سهام بهینه در بورس اوراق بهادار تهران با تلفیق مدل تفاوت میانگین جینی و جدول کارایی متقاطع

محل انتشار:

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

تعداد صفحات اصل مقاله: 6

نویسندگان:

کیخسرو یاکیده - استادیار، دانشکده مدیریت و اقتصاد، دانشگاه گیلان

غلامرضا محفوظی - استادیار، دانشکده مدیریت و اقتصاد، دانشگاه گیلان

ارمغان علی پور جورشری - کارشناسی ارشد، دانشکده مدیریت و اقتصاد، دانشگاه گیلان

خلاصه مقاله:

موفقیت در بازار سهام مانند هر بازار دیگری نیاز به انتخاب یک رویکرد مناسب دارد. در میان رویکردهای گوناگون برای سرمایه گذاری در بازار سهام، تشکیل سبد سهام بهینه می تواند میزان ریسک را کاهش داده و بازده سرمایه گذاری را در سطح مطلوبی نگه دارد. در این پژوهش تشکیل سبد سهام بهینه با یک رویکرد ابتکاری و تلفیق مدل تفاوت میانگین جینی و جدول کارایی متقاطع انجام می گیرد. از داده های بورس اوراق بهادار تهران در یک بازه زمانی 3 ساله استفاده شده است. جهت حل مدل از نرم افزار GAMS بهره گرفته شده است. با محاسبه بازده سبدهای پیشنهادی در سال بعد، عملکرد مطلوب رویکرد ارایه شده نشان داده می شود.

کلمات کلیدی:

مدل تفاوت میانگین جینی GMD، جدول کارایی متقاطع، مدل RAM سبد سهام بهینه

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/767194>

