

عنوان مقاله:

کاربرد رویکرد ریزی ترجیحات فازی لگاریتمی در انتخاب سبد سهام

محل انتشار:

چهارمین کنفرانس بین المللی مدیریت صنعتی (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

داریوش فرید - دانشیار، گروه حسابداری و مالی، دانشکده اقتصاد، مدیریت و حسابداری، دانشگاه یزد،

ابوالفضل دهقانی فیروزآبادی - دانشجوی دکتری مدیریت مالی، گروه حسابداری و مالی، دانشکده اقتصاد، مدیریت و حسابداری، دانشگاه یزد

حمیدرضا میرزایی - استادیار، گروه حسابداری و مالی، دانشکده اقتصاد، مدیریت و حسابداری، دانشگاه یزد

خلاصه مقاله:

مساله انتخاب سبد سهام همواره یکی از موضوعات جذاب و کاربردی در مسائل مالی و بازارهای مالی بوده است. این مساله تلاش می کند ترکیب بهینه ای از سرمایه گذاری در سهام و دارایی های مالی را به نحوی مشخص کند که بازده سرمایه گذاری بیشینه و ریسک سرمایه گذاری کمینه شود. تحقیقات زیادی در این زمینه انجام شده است و مدل ریاضی واریانس مارکویتز به عنوان یکی از اصلی ترین کارهای این حوزه شناخته می شود. با توجه به ماهیت بازارهای کنونی، انتخاب سبد سهام فرآیند پیچیده ای است که این پیچیدگی ناشی از تاثیر معیارهای مختلف در تصمیم های سرمایه گذاری و نیز ترجیحات شخصی سرمایه گذار است. بر این اساس شناسایی عوامل موثر بر انتخاب سهام و نیز وزن دهی مناسب آنها، اولین گام در طراحی مدل ریاضی مناسب جهت انتخاب سبد بهینه سهام است. در این مقاله، در مرحله اول، از طریق مصاحبه با خبرگان و نیز بررسی مدارک و اسناد موجود، معیارهای اصلی انتخاب سبد بهینه سهام شناسایی می شود و در ادامه کاربرد رویکرد برنامه ریزی ترجیحات فازی لگاریتمی در چگونگی تعیین وزن این معیارها ارائه می شود. نتایج نشان می دهد معیارهای سودآوری، کارایی و ریسک به ترتیب مهمترین معیارها در انتخاب سبد سهام هستند.

کلمات کلیدی:

بازار سهام، سبد سهام، برنامه ریزی ترجیحات فازی لگاریتمی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/938065>

