

عنوان مقاله:

به کارگیری برنامه ریزی ریاضی فازی در مسئله ی تعیین سبد بهینه سهام

محل انتشار:

ششمین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع (سال: 1387)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

ناصر شمس - دانشیار دانشکده مهندسی صنایع، دانشگاه صنعتی امیرکبیر

حسین دستخوان - کارشناسی ارشد مهندسی مالی، دانشگاه صنعتی امیرکبیر

خلاصه مقاله:

مسئله تعیین سبد سهام بهینه، یک مساله برنامه ریزی چند هدفه است که با در نظر گرفتن اهداف مختلف و متعارض، یک ترکیب بهینه از سهام مختلف را بدست می آورد. در این پژوهش، یک مدل تعیین سبد بهینه ی سهام با سه هدف بازده کلی، ریسک سبد و نقد شوندگی سبد مورد مطالعه قرار میگیرد. با توجه به ماهیت غیر قطعی مسائل مالی و وابستگی نتایج به ترجیحات سرمایه گذار، اهداف و محدودیت های موجود در مساله به صورت فازی در نظر گرفته شده اند. دو مدل متفاوت با در نظر گرفتن توابع عضویت مختلف برای اهداف و محدودیت ها ارائه شده است و نتایج حاصل از این دو مدل بر روی یک نمونه عملی از بورس اوراق بهادار تهران اعمال گردیده است. با استفاده از این مدل امکان تشکیل سبدهای اراضی کننده برای سرمایه گذاران مختلف با درجه ریسک پذیری متفاوت به وجود می آید.

کلمات کلیدی:

سبد سهام فازی، مدل میانگین- انحراف مطلق نیمه، برنامه ریزی ریاضی فازی، برنامه ریزی چند هدفه، پرتفولیوی بهینه

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/58868>

