

عنوان مقاله:

انتخاب سبد سرمایه گذاری بهینه در بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از رویکرد تلفیقی خوشه بندی و تصمیم گیری چند معیاره

محل انتشار:

نهمین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع و سیستم ها (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

نویسندگان:

ندا کریمی - استادیار گروه مهندسی صنایع، دانشگاه گیلان

علی موسی نژاد کماچالی - دانشآموخته مهندسی صنایع، دانشگاه گیلان

خلاصه مقاله:

در سالهای اخیر، بازار سهام به یکی از بازارهای جذاب و رو به رشد برای سرمایه گذاران تبدیل شده است. اما سرمایه گذاران برای افزایش دقت و سرعت در تصمیم گیری، نیاز به معیارهای درست بهینه سازی سبد سهام دارند. انتخاب درست این معیارها منجر به کاهش زیان های ناشی از سرمایه گذاری و همچنین افزایش بازده متناسب با ریسک می گردد. در این تحقیق با استفاده از تصمیم گیری چند معیاره و خوشه بندی راهکاری برای انتخاب بهینه سبد سهام ارائه شده و صنعت پتروشیمی مورد بررسی قرار گرفته است. بر اساس نتایج تحقیق، شرکت ها در حالت بهینه، به ۳ خوشه تقسیم شده اند. با استفاده از روش چند معیاره تاپسیس شرکت های موجود در هر یک از خوشه ها نیز مورد بررسی قرار گرفتند و نتایج بررسی مشخص کرد که شجم، زنجان و شپترو به عنوان برترین شرکت ها برای سرمایه گذاری در صنعت پتروشیمی می باشند.

کلمات کلیدی:

خوشه بندی، تصمیم گیری چند معیاره، انتخاب سبد سهام، پتروشیمی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1772947>

