

## عنوان مقاله:

انتخاب بهینه سبد سهام با استفاده از مدل شبکه عصبی - مصنوعی، اریما و مدل مارکویتز در بورس اوراق بهادار تهران

## محل انتشار:

اولین کنفرانس سالانه مدیریت، نوآوری و کارآفرینی (سال: 1389)

تعداد صفحات اصل مقاله: 21

## نویسندگان:

اکبر عالم تبریز - تهران، پونک، دانشگاه شهید بهشتی

محمد علی افشاری - قزوین، شهر صنعتی الوند

محمد حسن ملکی - تهران، دانشگاه تهران

جواد محمدی - تهران، دانشکده مدیریت،

## خلاصه مقاله:

همواره انتخاب بهینه سبد سهام یکی از مهم ترین مسائل پیش روی سرمایه گذاران و مدیران مالی است. در تحقیق حاضر ابتدا با مطالعه بازارهای مالی و نقش آن ها در اقتصاد به تحلیل داده ها می پردازیم. در تحقیق حاضر برای انتخاب بهینه سبد سهام از سه مدل شبکه عصبی- مصنوعی، مدل مارکویتز و مدل خطی اریما برای پیش بینی و انتخاب بهینه سبد سهام استفاده شد. 10 سهام از ده صنعت مختلف برای تحلیل مدل انتخاب گردید. سپس با توجه به خرجی مدل های سه گانه ی فوق سهام هایی را که میانگین بازده پیش بینی آن ها بیشتر و ریسک کم تری را دارا بودند انتخاب می گردد. برای مقایسه مدل ها از آزمون میانگین دو جامعه (t-test) در سطح معنی داری 95% استفاده شد که در نهایت شبکه عصبی به عنوان بهترین مدل شناسایی گردید.

## کلمات کلیدی:

: سبد سهام (پرتفوی)، بازده، ریسک، شبکه عصبی - مصنوعی، مدل مارکویتز، بازار مالی، اریما

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/108071>

