

اولویت بندی عوامل موثر بر انتخاب سبد سهام و بازده موردانتظار با استفاده از فرآیند تحلیل شبکه های فازی

حسین شرافتمند*,182,

1395-11-29

چکیده هدف اصلی این پژوهش انتخاب سبد سهام بهینه با استفاده از تکنیکهای تصمیم گیری چند معیاره است که جهت انجام آن، ابتدا معیارهای انتخاب سهام با بررسی ادبیات تحقیق شناسایی شده و سپس اولویت بندی معیارهای مشخص شده با استفاده از نظر خبرگان و تکنیک فرآیند تحلیل شبکه ای فازی تکنیک از استفاده با و شده مشخص معیارهای به توجه با شرکتها سپس و شدند بندي اولویت ANP (تاپسیس) و الگوریتم ممتیک اولویت بندی شده و سبد بهینه تشکیل می شود. در نهایت نیز بازده شرکتهای قرار گرفته در سبد سهام انتخابی و شرکتهای انتخاب نشده مورد مقایسه قرار گرفت. روش پژوهش این تحقیق از نظر ماهیت و محتوا از نوع همبستگی و از نظر هدف از نوع کاربردی می باشد. براساس خروجی تکنیک FANP می توان ملاحظه کرد زمانیکه روابط درونی متغیرهای پژوهش نیز در نظر گرفته شود میزان اهمیت و رتبه شاخص های مطالعه تغییر خواهد کرد. بنابراین ریسک تجاری با وزن 1243/0 در اولویت نخست قرار دارد. حاشیه سود خالص با وزن 909/0 در اولویت دوم قرار دارد. نسبت قیمت به درآمد با وزن 0883/0 سومین شاخص با اهمیت است.

کلمات کلیدی : کلمات کلیدی: سبد سهام بهینه، تکنیکهای تصمیم گیری چند معیاره، تحلیل شبکه ای، بازده سهام

[Islamic Azad University, Rasht Branch - Thesis Database](#)
[دانشگاه آزاد اسلامی، واحد رشت - سامانه بانک اطلاعات پایان نامه ها](#)