

# بهینگی پرتفوی سهام با استفاده از ارزش در معرض ریسک در شرکت های تولیدی

میترا مرادی\*, 178,

1396-11-03

چکیده مدیریت پرتفوی فعال که تخصیص منابع بر اساس یک استراتژی فعال است و هدف اصلی آن تنها به دست آوردن سود و بازدهی مثبت نیست بلکه به دنبال کسب بازدهی بالاتر از معمول است. منظور از بازدهی اضافی داشتن عملکردی بهتر از پرتفوی معیار است. هدف از این تحقیق بهینگی پرتفوی سهام با استفاده از ارزش در معرض ریسک در شرکت های تولیدی (صنایع غذایی) می باشد. در این راستا از آمار و اطلاعات قیمت-های هفتگی سهام 21 شرکت طی سال-های 1392 الی 1394 استفاده شده است. در این تحقیق از روش حداقل-سازی ارزش در معرض ریسک پرتفوی با توجه به بازده مورد انتظار معین به وسیله الگوریتم ژنتیک و لینگو ارائه شده است. نتایج نشان داده که الگوریتم ژنتیک با توجه به بررسی فضای جواب بهتر می-تواند پرتفوی مناسب را تشخیص دهد، میزان اختلاف وزن ها توسط الگوریتم ژنتیک 2.49 درصد و توسط لینگو 4.22 بوده است، بنابراین الگوریتم ژنتیک به دلیل جستجو در فضای جواب بهتر توانسته وزن های مناسب برای پرتفوی بهینه را محاسبه نماید. کلید واژه : سبد بهینه سهام، ارزش در معرض ریسک، الگوریتم ژنتیک.

کلمات کلیدی : کلید واژه : سبد بهینه سهام، ارزش در معرض ریسک، الگوریتم ژنتیک.

[Islamic Azad University, Rasht Branch - Thesis Database](#)

[دانشگاه آزاد اسلامی، واحد رشت - سامانه بانک اطلاعات پایان نامه ها](#)