

## بهینه سازی وزن‌های اوراق بهادر با استفاده از اصل ماکسیمم آنتروپی

A- ۱۰-۳۲۷-۲

الله رزا مشهدی<sup>۱</sup> - باقر مقدس زاده براز<sup>۱</sup> - غلامرضا محتممی برزادران<sup>۲</sup>

۱ گروه آمار دانشگاه پیام نور مشهد

۲ گروه آمار دانشگاه فردوسی مشهد

**چکیده:** نظریه اوراق بهادر به موضوعات و مفاهیمی می‌پردازد که در جامعه کاملاً شناخته شده و قابل درک هستند. از گسترده ترین روش‌های حل این نظریه، انتخاب اوراق بهادر کارا در مدل میانگین - واریانس مارکوز می‌باشد. این مدل یکی از رایج‌ترین فرمول بندهای انتخاب اوراق بهادر بوده و هدف آن، انتخاب بردار وزن‌های اوراق بهادر است. در این مقاله، ضمن تعریف وزن‌های اوراق بهادر در دارایی‌های مالی مختلف، مسئله انتخاب اوراق به کمک روابط آماری و ریاضی مطالعه و در انتهای به کمک اصل ماکسیمم آنتروپی، وزن‌های بهینه محاسبه می‌شود.

**واژه‌های کلیدی:** اوراق بهادر کارا، مدل میانگین - واریانس مارکوز، اصل تنوع، تابع مطلوبیت، قیمت نسبی، رفع ریسک احتمالی