



## اولین کنفرانس ملی حسابداری و مدیریت (1392)

بهینه سازی بازده سهام با استفاده از بازده های فازی تصادفی

نویسنده‌گان:  
محمد رضا کهنسال - دانشیار دانشگاه فردوسی مشهد  
نسترن ناجکار - دانشجوی دکتری اقتصادکشاورزی

### خلاصه مقاله:

در این تحقیق انتخاب پرتفوی با در نظر گرفتن مسائلی همچون بازده های احتمالی آینده و بازده های انتظاری نامعین بررسی شد، که همواره یکی از چالشهای اصلی پیش روی سرمایه گذاران می باشد. در انتخاب سبد سهام فازی تصادفی، مدل بصورت غیر خطی فرموله بندی شد. متغیرها به صورت اعداد فازی تصادفی در نظر گرفته شدند. سپس، نتایج مدل بهینه سازی فازی تصادفی با نتایج حاصله از روش حرکت تجمعی ذرات مقایسه گردید.

### كلمات کلیدی:

پرتفوی ، برنامه ریزی غیرخطی ، متغیر فازی تصادفی ، روش حرکت تجمعی ذرات

دربافت اصل مقاله: [http://www.civilica.com/Paper-FNCAM01-FNCAM01\\_238.html](http://www.civilica.com/Paper-FNCAM01-FNCAM01_238.html)