



بهبینه سازی اوراق بهادار براساس اصل ماکسیمم آنتروپی

۱. رزاز مشهدی^{۱*}، غ. یاری^۱ و غ. محتشمی برزادران^۲

^۱ دانشگاه آزاد اسلامی، واحد علوم و تحقیقات تهران

^۲ گروه آمار، دانشگاه فردوسی مشهد

چکیده: داشتن اوراق بهادار بهینه با نرخ بازگشتی بالا و ریسک پایین از موضوعاتی است که مورد توجه بسیاری از محققان است. در این مقاله، ضمن مروری بر روش های رایج در برآورد بهینه ی اوراق بهادار، اوراق بهینه را براساس اصل ماکسیمم آنتروپی برآورد می کنیم. در ادامه، با یک مثال کاربردی نشان می دهیم که اوراق بهادار حاصل از ماکسیمم آنتروپی از اصل تنوع پیروی می کند.

واژه های کلیدی: اوراق بهادار، اصل تنوع، بهینه سازی، آنتروپی.

*Email: elahe.razza@gmail.com