

بهینه سازی پویایی پرتفوی بر اساس حجم
معاملات
(شرکت های بورس اوراق بهادار)

صادق خدیور



سرشناسه	: خدیور، صادق، ۱۳۶۹-
عنوان و نام پدیدآور	: بهینه‌سازی پویایی پرتفوی بر اساس حجم معاملات (شرکت‌های بورس اوراق بهادار)/ صادق خدیور.
مشخصات نشر	: تهران: انتشارات حانون، ۱۳۹۹.
مشخصات ظاهری	: ۸۶ ص.: مصور، جدول.
شابک	: ۹۷۸-۶۳۲-۷۴۸۲-۱۲-۶
وضعیت فهرست نویسی	: فیبا
یادداشت	: کتابنامه: ص. [۷۹] - ۸۶.
موضوع	: مدیریت سبد سرمایه‌گذاری -- ایران -- نمونه پژوهی
موضوع	: Portfolio management -- Iran -- Case studies
موضوع	: سرمایه‌گذاری -- ایران -- تجزیه و تحلیل -- نمونه پژوهی
موضوع	: Investment analysis -- Iran -- Case studies
موضوع	: بورس -- ایران -- نمونه پژوهی
موضوع	: Stock exchanges -- Iran -- Case studies
موضوع	: مدیریت ریسک مالی -- ایران -- نمونه پژوهی
موضوع	: Financial risk management -- Iran -- Case studies
رده بندی کنگره	: HC ۴۵۳/۵
رده بندی دیویی	: ۳۳۲/۰۹۵۵
شماره کتابشناسی ملی	: ۱۰۱۳۳۰۰



بهینه سازی پویایی پرتفوی بر اساس حجم معاملات
(شرکت های بورس اوراق بهادار)

ناشر: انتشارات حانون

نویسنده صادق خدیور

صحافی: حانون

نوبت چاپ: اول

تاریخ انتشار: ۱۳۹۹

شابک: ۹۷۸-۶۳۲-۷۴۸۲-۱۲-۶

تیراژ: ۱۰۰۰ نسخه

قیمت: ۲۵۰۰۰۰ ریال

فهرست مطالب

۷	فصل اول: کلیات کتاب
۹	مقدمه
۱۱	اهمیت موضوع
۱۲	تعاریف نظری
۱۵	فصل دوم: مبانی نظری
۱۷	مقدمه
۱۸	تاریخچه بورس در دنیا و ایران
۱۸	تاریخچه بورس در دنیا
۱۹	تاریخچه بورس در ایران
۲۱	مفاهیم سرمایه گذاری
۲۱	سرمایه گذاری
۲۲	ریسک سرمایه گذاری
۲۳	ریسک های پویا و ایستا
۲۳	ریسک های سوداگرانه و خالص
۲۳	ریسک های خاص و عام
۲۳	ریسک های سیستماتیک و غیر سیستماتیک
۲۴	ریسک های کشوری و بین المللی
۲۴	شاخص های محاسبه ریسک
۲۶	بازده سرمایه گذاری
۲۷	سبد سهام و متنوع سازی
۳۰	نظریه نوین پرتفوی (MPT)

۳۰	مدل مارکویتز.....
۳۲	مدل نیمه واریانس مارکویتز.....
۳۳	مدل قیمت گذاری دارایی های سرمایه ای (CAPM).....
۳۵	مدل های تک عاملی.....
۳۶	مدل های چند عاملی.....
۳۷	نظریه قیمت گذاری آربیتراژ.....
۳۸	انواع مسائل بهینه سازی و طبقه بندی آن.....
۳۹	بهینه سازی تک بعدی و بهینه سازی چند بعدی.....
۳۹	بهینه سازی پویا و بهینه سازی ایستا.....
۳۹	بهینه سازی مقید و نامقید.....
۴۰	بهینه سازی پیوسته و ناپیوسته.....
۴۰	بهینه سازی در معیاره و چند معیاره.....
۴۰	بهینه سازی چند هدفه.....
۴۲	ارزیابی عملکرد.....
۴۲	حجم معاملات در بازار بورس.....
۴۵	هزینه های انجام معاملات.....
۴۶	روز و ساعت انجام معاملات.....
۴۶	برنامه ریزی پویا.....
۴۷	مطالعات انجام شده در این زمینه.....
۶۱	فصل سوم: فرایند پیش بینی اتفاقات و احتمالات بر اساس داده های فعلی.....
۶۳	مقدمه.....
۶۳	تجزیه و تحلیل داده ها.....
۶۴	اعتبار سنجی مدل.....
۷۳	آزمون فرض.....
۷۶	نتیجه گیری.....
۷۷	مقایسه یافته ها با مطالعات انجام شده.....
۷۹	منابع و مآخذ.....