

درآمدی بر شبیه‌سازی مونت کارلو در بازار سهام

www.ketab.ir

مؤلفان

محمد سجادیان

دکتر محمود همت‌فرد

دکتر علیرضا غیاثوند

فهرست نویسی

سرشناسه	:	سجادیان، محمد، ۱۳۷۳
عنوان و نام پدیدآور	:	درآمدی بر شبیه سازی مونت کارلو در بازار سهام/مؤلفان محمد سجادیان، محمود همت فرد، علیرضا غیاثوند
مشخصات نشر	:	تهران، رشد فرهنگ، ۱۴۰۱
مشخصات ظاهری	:	۷۸ ص؛ ۵/۳۱×۵/۱۴ س.م
شابک	:	۹۷۸-۶۳۲-۳۰۵-۵۵۷-۸
وضعیت فهرستنویسی	:	فیا
یادداشت	:	کتابنامه
عنوان دیگر	:	روش مونت کارلو -- داده پردازی Monte Carlo method --
موضوع	:	سهام -- داده پردازی Stocks -- Data processing
شناسه افزوده	:	همت فرد، محمود، ۱۳۵۰
شناسه افزوده	:	غیاثوند، علیرضا، ۱۳۵۲
رده بندی کنگره	:	QA۲۹۸
رده بندی دیویی	:	۵۹/۳۸۲
شماره کتابشناسی ملی	:	۸۸۶۴۶۹۳
اطلاعات رکورد کتابشناسی	:	فیا

این اثر مشمول قانون حمایت حقوق مؤلفان و مصنفان و هنرمندان مصوب ۱۳۴۸/۱۰/۱۱ است. فردی که تمام یا بخشی از این اثر را بدون اجازه ناشر، حروف چینی، چاپ، فتوکی و انواع دیگر چاپ، عکس برداری، تبدیل به pdf و به هر شکلی تکثیر، نشر، پخش و یا عرضه کند، در صورت آگاهی پدیدآورنده، مورد پیگرد قانونی قرار خواهد گرفت و در هر صورت از نظر اخلاقی، شرعی و قانونی غیرمجاز است.

استفاده علمی به شکل متعارف و با ذکر منبع مجاز است.

نام کتاب	:	درآمدی بر شبیه‌سازی مونت کارلو در بازار سهام
مؤلفان	:	محمد سجادیان، دکتر محمود همت‌فرد، دکتر علیرضا غیاثوند
صفحه‌آرایی	:	انتشارات رشد فرهنگ
طراح جلد	:	مهندس ریحانه رحیمی
لیتوگرافی، چاپ و صحافی	:	واصف
نوبت چاپ	:	اول - بهار ۱۴۰۱
شمارگان	:	۳۰۰ نسخه
بها	:	۳۵۰۰۰ تومان
قطع و رنگ	:	رقعی سیاه و سفید

www.ketab.ir

فروش اینترنتی: roshdefarhang.ir



انتشارات رشد فرهنگ

شابک: ۹۷۸-۶۲۲-۲۰۵-۵۵۷-۸

ISBN: 978-622-205-557-8

کلیه حقوق این اثر برای ناشر و مؤلف محفوظ است

آدرس: تهران، خیابان مرتضوی، بعد از تقاطع جیحون، پلاک ۷۰۶

تلفن: ۰۲۱-۶۶۳۷۷۵۷۰

Email: roshdefarhang@yahoo.com

فهرست مطالب

۹	 مقدمه
۱۶	 اهمیت پیش‌بینی‌پذیری سرمایه‌گذاری
۲۳	 شبیه‌سازی مونت کارلو
۲۴	 تاریخچه شبیه‌سازی مونت کارلو
۲۶	 اعداد تصادفی
۲۹	 تولیدکننده‌های اعداد تصادفی
۳۲	 روش‌های تولید اعداد تصادفی
۳۳	 فرآیند شبیه‌سازی مونت کارلو
۳۴	 روش‌های شبیه‌سازی مونت کارلو
۳۶	 کاربردهای شبیه‌سازی مونت کارلو
۳۸	 مزایا و معایب شبیه‌سازی مونت کارلو
۴۰	 پژوهشهای انجام شده پیرامون شبیه‌سازی مونت کارلو
۵۹	 منابع
۷۳	 پیوست: برنامه شبیه‌سازی مونت کارلو

مقدمه

با توجه به اهمیت روزافزون سرمایه‌گذاری در بازارهای مالی و همچنین توجه ویژه سرمایه‌گذاران به بازدهی میزان سرمایه‌گذاری خود در این بازارها سرمایه‌گذاران را بر آن داشت تا با اتخاذ نحوه صحیح سرمایه‌گذاری و همچنین اتخاذ استراتژی مناسب در موقعیت‌های مختلف برای کسب سود بیشتر تلاش کنند.

نوسان‌پذیری یا تغییرپذیری^۱ از آن دسته متغیرهای مهمی است که در دهه‌های اخیر برای مدل‌سازی آن تلاش‌های بسیاری صورت پذیرفته است. پیش‌بینی این متغیر در مدیریت ریسک، ارزش‌گذاری سبد سرمایه، قیمت‌گذاری مشتقات و ... دارای کاربردهای فراوانی است. با دست یافتن به الگوهای نوسان بازده سهام و با پیش‌بینی پذیری بازدهی سهام می‌تواند تخصیص استراتژی سرمایه را به شکل هموارتر و کاراتر صورت داد. بازار دیدگاه معامله‌گران بازار مشتقات، درک نوسان‌پذیری، پیش‌بینی دقیق آن و حفاظت از دارایی‌های پرتفوی در مقابل هزینه‌هایی که این متغیر به ارزش کل تحمیل می‌کند، از اهمیت دو چندان برخوردار می‌باشد. دانستن این واقعیت که معاملات و ابزارهای مشتقه در فضای بازار سرمایه ایران روندی تکاملی به خود گرفته است، بر ضرورت اجرای تحقیقات کاربردی بیشتر در این حوزه می‌افزاید.

^۱ Volatility