

کاربرد پژوهش عملیاتی در تحلیل بازارهای مالی

سید کامران یگانگی^۱، صبا کریمیان یوسفی^۲

^۱ عضو هیئت علمی، گروه مهندسی صنایع، واحد زنجان؛ دانشگاه آزاد اسلامی، زنجان، ایران

^۲ دانشجوی کارشناسی ارشد، گروه مدیریت مالی، واحد زنجان؛ دانشگاه آزاد اسلامی، زنجان، ایران

چکیده

در یک تقسیم‌بندی ابتدایی و ساده اقتصادی، می‌توان مردم را به دو دسته تقسیم کرد. دسته اول کسانی هستند که پول و سرمایه و پس‌انداز دارند، اما نمی‌توانند فعالیت اقتصادی انجام دهند. دسته دوم نیز افرادی هستند که توانایی انجام کار اقتصادی دارند، اما به سرمایه برای انجام آن نیازمندند. از طرفی، سرمایه و پس‌انداز همه مردم با هم برابر نیست و سلیقه و هدف آن‌ها برای سرمایه‌گذاری با هم تفاوت دارد؛ برخی اهداف کوتاه‌مدتی دارند و برخی بلندمدتی. بازاری که همه این تفاوت‌ها را در نظر می‌گیرد و امکان حضور همه در آن میسر است، بازار سرمایه و بورس است. بورس، بازاری است که نیاز به یادگیری دارد و شما نیز برای فعالیت در بورس فقط به اینترنت و حداقل سرمایه و یک اراده برای کسب ثروت نیاز دارید. برای موفقیت در بازار بورس لازم است بتوانیم این بازار را به کمک روش‌هایی تحلیل کنیم. هدف این مقاله یافتن کاربرد پژوهش عملیاتی در حوزه‌ی تحلیل بازارهای مالی است. تکنیک‌های مختلف پژوهش عملیاتی مانند برنامه‌ریزی خطی، مدل هیلیر و هرتز و الگوی مارکوویتز و LPP و سیمپلکس و سایر مدل‌ها همگی برای رسیدگی به طیف گسترده‌ای از چالش‌های بازار سهام استفاده شده‌اند. موضوع بهینه‌سازی سبد سهام را با در نظر گرفتن الگوی مدل مارکوویتز و ارزش در معرض ریسک نشان می‌دهد. مطابق با الگوی مارکوویتز، ریسک با نوسان‌های بازده مرتبط است و نوسان‌ها توسط واریانس بازده اندازه‌گیری می‌شود. مقاله حاضر نشان می‌دهد رسیدن به بهترین راه‌حل‌های موجود برای کاهش یا اجتناب از ریسک و افزایش سود و بازدهی در بازار مالی از طریق تکنیک‌های تحقیق در عملیات در تحلیل بازارهای مالی و ارائه نمای کلی از کاربردهای تحقیق در عملیات در زمینه بازار مالی است. این موضوع به سرمایه‌گذار کمک می‌کند تا تصمیم بادقت بالاتر در رابطه با سرمایه‌گذاری خود بگیرد.

واژه‌های کلیدی: پژوهش عملیاتی، بازارهای مالی، پرتفوی سرمایه‌گذاری

مطالعات مهندسی صنایع و مدیریت تولید

دوره ۷، شماره ۳، پاییز ۱۴۰۰، صفحات ۶۱-۵۱