



بخشی از ترجمه مقاله

عنوان فارسی مقاله :

بازده و خطرات ناشی از سبد سرمایه گذاری در بازارهای مالی

عنوان انگلیسی مقاله :

The returns and risks of investment portfolio
in a financial market



توجه !

این فایل تنها قسمتی از ترجمه میباشد. برای تهیه مقاله ترجمه شده کامل با فرمت ورد (قابل ویرایش) همراه با نسخه انگلیسی مقاله، [اینجا](#) کلیک نمایید.



بخشی از ترجمه مقاله

4. Conclusions

In this paper, we propose a model for investment portfolio based on the Heston model, and then we investigate the roles of investment portfolio in a financial market based on the Heston model. The returns and risks of investment portfolio of two stocks are discussed by calculating the equity portfolio return from the theoretical and real data. The maximum dispersion of investment portfolio maximally enhances the stability of the equity portfolio return and reduces investment risks. An increase of investment period of portfolio is associated with a decrease of stability of the equity portfolio return, and a maximum investment risk is induced by a worst investment period. In addition, we compare the probability density function, the variance and loss rate of equity portfolio return from theoretical simulating results with that from \hat{DJI} data and find good agreement.

4. نتیجه گیری

در این مقاله، ما مدلی را برای پرتفوی سرمایه گذاری پیشنهاد می کنیم که مبتنی بر مدل هستون است و سپس نقش پرتفوی سرمایه گذاری در بازار مالی مبتنی بر مدل هستون را مورد بررسی قرار می دهیم. بازده و ریسک پرتفوی سرمایه گذاری دو سهام به وسیله محاسبه بازده پرتفوی سهام، از طریق داده های واقعی و نظری، مورد بحث قرار می گیرد. حداکثر پراکندگی پرتفوی سرمایه گذاری به میزان زیادی ثبات بازده پرتفوی سهام را افزایش می دهد و متقابلاً ریسک سرمایه گذاری کاهش می یابد. افزایش مدت سرمایه گذاری پرتفوی با کاهش ثبات بازده پرتفوی سهام مرتبط است، و حداکثر ریسک سرمایه گذاری به وسیله بدترین دوره سرمایه گذاری کاهش می یابد. علاوه بر این، ما تابع چگالی احتمال، واریانس و نرخ کاهش بازده پرتفوی سهام را از طریق نتایج نظری شبیه سازی شده، با داده های DJI مقایسه می کنیم تا به یک توافق خوبی برسیم.



توجه!

این فایل تنها قسمتی از ترجمه میباشد. برای تهیه مقاله ترجمه شده کامل با فرمت ورد (قابل ویرایش) همراه با نسخه انگلیسی مقاله، [اینجا](#) کلیک نمایید.

همچنین برای مشاهده سایر مقالات این رشته [اینجا](#) کلیک نمایید.