

المستخلص

محمد زاهد. 2014، الأطروحة. العنوان: "تحديد المحفظة المثلى لنموذج ترينور الأسود مع أساليب تقييم أداء حافظه جنسن، وشارب، ترينور، سورتينو، ونسبة المعلومات، T2 و M2" (دراسة حالة بشأن "مخزونات JII الفترة" يونيو 2010 حتى مايو 2014)

المشرف: فيترية، درجة البكالوريوس الاجتماعي. ماجستير في الإدارة
كلمات مم: عودة المخاطر والمحفظة المثلى ونموذج ترينور الأسود

المشكلة كثيرا ما يواجهها المستثمرون من عدم اليقين العائد والمخاطر التي يمكن اكتسابها من استثمارات. لتقليل المخاطر وتعظيم العائد، حاجة المستثمرين تشكيل محفظة. هناك عدة طرق لحافظة، بين آخرين، واحد مؤشر الأسلوب، ماركويتز، والأسود ترينور. وكان الغرض من هذه الدراسة تحديد مدى انطباق الأسلوب "نموذج" ترينور الأسود في صياغة المحفظة المثلى ومعرفة أداء حافظه "نموذج" ترينور السوداء التي شكلت.

هذا البحث بحث وصفي مع النهج الكمي، باستخدام دراسات الحالة. السكان في هذا البحث هو أسهم JII. عينة البحث أسهم 13 قدر من JII التي تم الحصول عليها بطريقة أخذ العينات الهادفة. أساليب التحليل المستخدمة لوصف أسلوب نماذج ترينور الأسود في شكل محفظة مثلى. القيام بأداء أساليب التقييم جنسن، شارب، ترينور، سورتينو، و "نسبة المعلومات"، M^2 و T^2 . حافظه ترينور الأسود.

أظهرت نتائج التحليل أن الأسلوب حافظه 1) مع "نموذج" ترينور الأسود تشكلت محفظة مثلى التي تتألف من تسعة أسهم JII. UNVR, KLBF, TLKM, AALI, LSIP, ASII, LKPR, ASRI, و INTP عن طريق توليد قيمة إرجاع 2.85%. ومستوى الخطر من 0.23%. القيمة الناتجة أفضل من قيمة السوق. و. حافظه مؤشر واحد. 2) من نتائج أسلوب تقييم الأداء جنسن، وشارب، ترينور، سورتينو، و "نسبة المعلومات"، T^2 و M^2 ، حافظه ترينور الأسود أظهر أداء جيد لأن قيمة التقييم الشامل للقيمة الناتجة إيجابية. نتائج التقييم لحافظة "نموذج" ترينور الأسود أفضل من أسلوب الحافظة مؤشر واحد. يمكن استخدام "نموذج" ترينور الأسود حافظه أسلوب في الرسم حتى المحفظة المثلى مع الأداء الجيد.