

بررسی نحوه انتخاب پورتفولیوی بهینه

فرزانه بیگ زاده عباسی^۱، مژگان پورنامداری^۲ معصومه روحی میرحسینی^۳

^۱ عضو هیات علمی دانشگاه آزاد واحد کرمان

farzanehbigzadeh@yahoo.com

^۲ دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت دولتی - مالی دانشگاه آزاد واحد رفسنجان

mojganpurnamdari@yahoo.com

^۳ دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت دولتی - مالی دانشگاه آزاد واحد رفسنجان

masomehroohi@yahoo.com

چکیده

سبد پروژه یا پورتفولیو، مجموعه ای از پروژه ها یا طرح ها و سایر کارها که به منظور مدیریت کاراتر در یک گروه طبقه بندی می شوند. مدیریت پورتفولیو با ارائه دقت نظر و حساسیتی در برنامه های استراتژیک شروع شده و با انتخاب صحیح پروژه ها خاتمه می یابد. در این مقاله سعی شده است تا پورتفولیو، ویژگی های آن، مدیریت پورتفولیو، دلیل نیاز به پورتفولیو، مدیریت استراتژیک پورتفولیو و اهداف مدیریت پورتفولیو پروژه، فاکتورهای مهم در انتخاب پورتفولیو، ریسک و انواع آن، مقایسه طرحها از نظر ریسک و بازده، مدل مارکوویتز، تعیین و انتخاب پرتفوی بهینه و کارآ تشریح گردد.

واژگان کلیدی: پورتفولیو، مدیریت پورتفولیو، انتخاب پورتفولیو بهینه

A survey of the selection method of optimal portfolio

Farzane Beigzade Abasi^۱, Mozghan Pournamdari^۲, Masume Ruhi Mirhosseini^۳

^۱ Faculty member of Azad University of Kerman

farzanehbigzadeh@yahoo.com

^۲ MA of administrative-financial management, Azad University of Rafsanjan branch; E-mail:

mojganpurnamdari@yahoo.com

^۳ MA of administrative-financial management, Azad University of Rafsanjan branch; E-mail

masomehroohi@yahoo.com

Abstract

Portfolio is the set of projects or plans and other tasks that are classified for efficient management in a group. Portfolio management is started by accuracy and sensitivity in strategic plans and is finished by appropriate selection of projects. The present study attempted to explain portfolio, its features, portfolio management, the reason to need portfolio, strategic management of portfolio and goals of portfolio management of project, important factors in selection of portfolio, risk and different types, the comparison of plans in terms of risk and returns, **Markowitz** model and selection of optimal and efficient portfolio.

Keywords: Portfolio, Portfolio management, Optimal portfolio selection