

الخلاصة

هدفت هذه الدراسة الى تطبيق نموذج البرمجة التربيعية على قطاعات سوق دبي المالي للفترة ٢٠٠٩-٢٠١٤ لاختيار المحافظ الاستثمارية المثلى ومن خلال توظيف الاداة Excel Solver لحل مسألة البرمجة التربيعية، ومن اجل اظهار أثر التنوع على المحافظ الاستثمارية المثلى في سوق دبي المالي على افتراض اتباع ثلاثة سياسات للتنوع (منخفضة، متوسطة، مرتفعة). ان تطبيق سياسية التنوع على المحافظ الاستثمارية المثلى في سوق دبي المالي سيقود الى تدنية المخاطر بنسب أكبر من انخفاض العوائد، كما اظهرت النتائج ان هنالك علاقة طردية بين العوائد الممكنة والمخاطر التي تقابلها للمحافظ الاستثمارية المثلى وفي ظل سياسات التنوع المختلفة.

...