



Amirkabir University of Technology
(Tehran Polytechnic)

مسئله ردیابی شاخص

مدرس

دکتر هوشمند خلیق

ارائه کننده

محمد برنوسی (9713007) (mohammadbornosi@gmail.com)

محمد رضا اردستانی (9513004) (ardestani.zr@gmail.com)

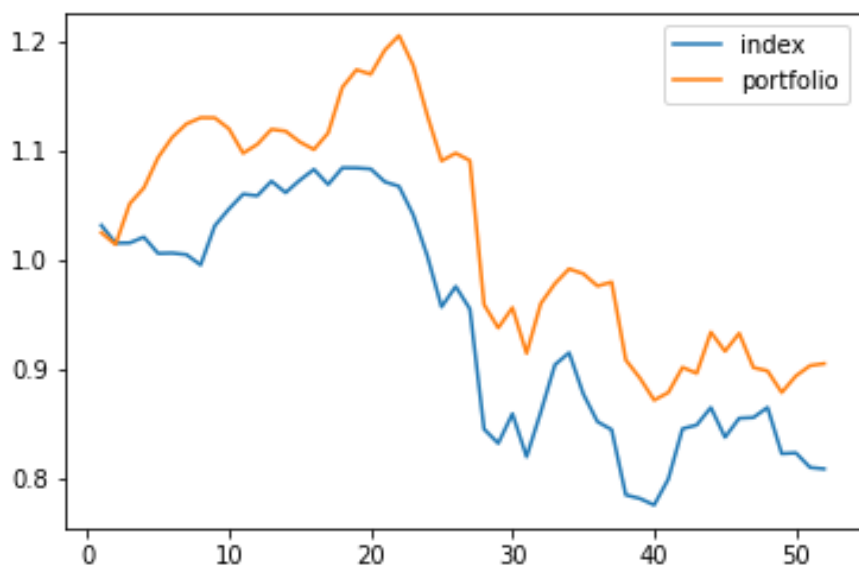
توضیحات اولیه

برای مقایسه سبد تشکیل شده و شاخص و ارزیابی ردیابی معیار هایی در نظر گرفته شده که به شرح زیر هستند :

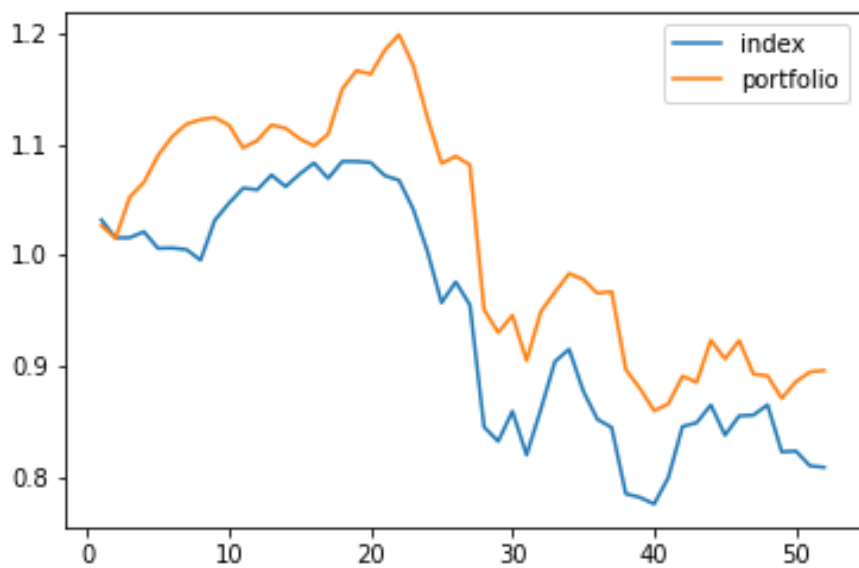
• معیار اول

ارزش سبد و شاخص در دوره های مختلف که نحوه محاسبه آن بیان شده
تحلیل نمودار های ارزش سبد و شاخص بر روی دیتا ست های مختلف به ازای سبد های 10 و 15 سهمه :

دیتا ست 1 :



10 سه



15 سه

دیتا ست دوم :

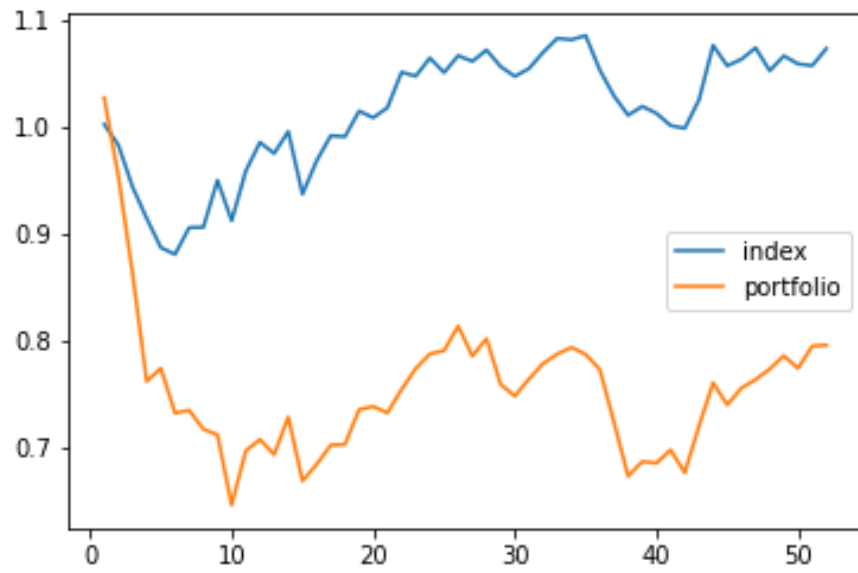


10 سه

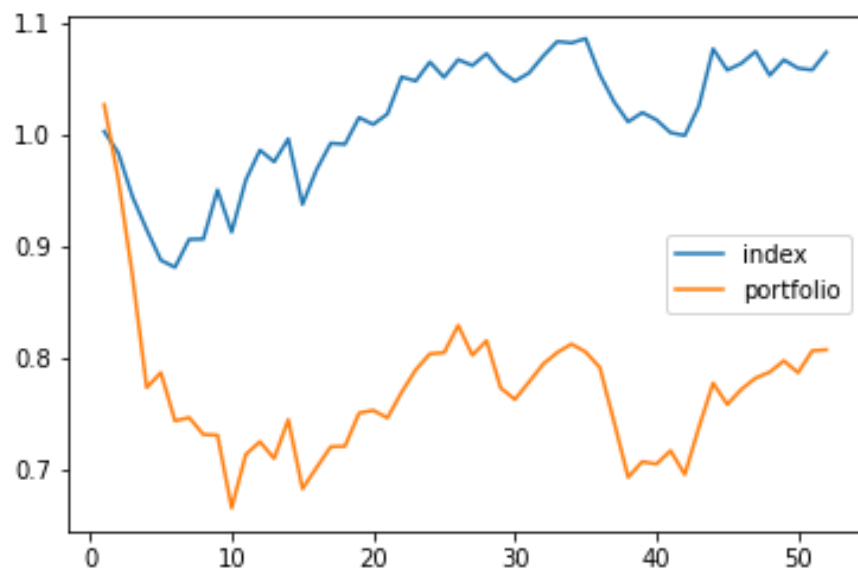


15 سه

دیتاست سوم :

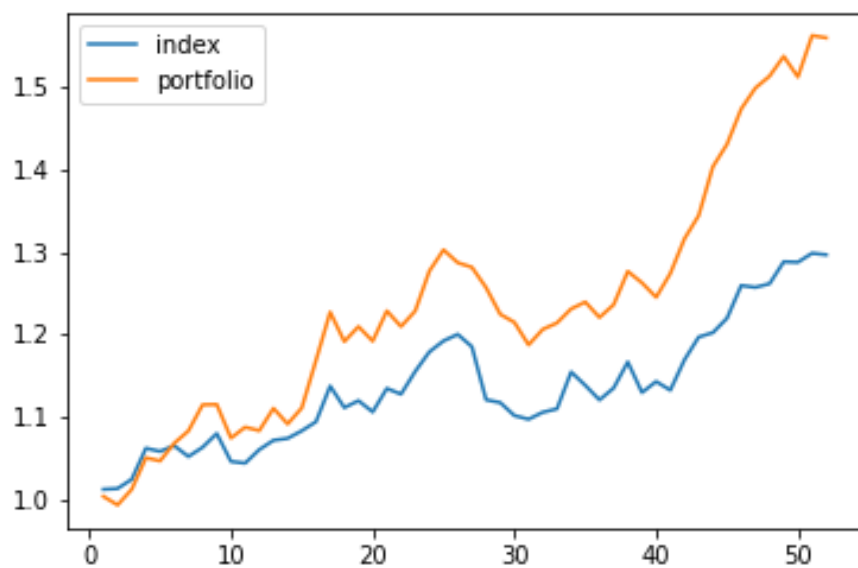


10 سه



15 سه

دیتا ست چهارم :



10 سه



15 سه

تحلیل روی دیتاست های مختلف :

همان طور که مشاهده میشود ارزش سبد 10 سهم وسبد 15 سهم نوسانات مربوط به ارزش شاخص در هفته های سال سوم را به خوبی ردیابی میکند و با تغییر 10 سهم به 15 سهم دقت ردیابی در بعضی دیتاست ها افزایش و در بعضی کاهش می یابد و میتوان گفت که افزایش سهم صرفا محدودیت های مربوط به مدل را کاهش نمی دهد و بستگی به دیتاست دارد که این افزایش تاثیر مثبت یا منفی در دقت ردیابی داشته باشد اما میتوان گفت که با این میزان تغییرات در سهم تغییر فاحشی را در میزان دقت ردیابی نمیبینیم