

عنوان مقاله:

پیش بینی تغییر پذیری در حضور نوفه ای که با زمان تغییر می کند

محل انتشار:

همایش منطقه ای پژوهشهای نوین در ریاضی (سال: 1390)

تعداد صفحات اصل مقاله: 6

نویسندگان:

سیده هلیا طباطبایی اوره - دانشگاه علامه طباطبائی_گروه آماری، ریاضی و کامپیوتر

محمدرضا صالحی راد - دانشگاه علامه طباطبائی_گروه آماری، ریاضی و کامپیوتر

خلاصه مقاله:

تغییر پذیری در بازار مالی عنصری ضروری برای دارایی و قیمت گذاری مشتقات و مدیریت ریسک می باشد. از آن جایی که تغییر پذیری، متغیری نیست که مستقیماً قابل مشاهده باشد، محققان زیادی برای پیش بینی آن وارد عمل شده اند. رویکرد عمده ای که بسیاری از دانشمندان برای پیش بینی تغییر پذیری استفاده کرده اند، بکارگیری مدل های آماری است که در ARCH و..... پیشنهاد شده است. روش دیگر فرموله کردن و به کار گیری مدل های اقتصادی است. همه ی این رویکردها در این موضوع که اندازه تغییر پذیری تحت مفروضاتی معتبر است، در اشتراکند. ولی این موضوع که کدامیک از این مفروضات در عمل ما را به تغییر پذیری واقعی نزدیک تر می کند، سوالی است که در بیشتر مواقع جواب آن معلوم نیست. روش دیگر در پیش بینی تغییر پذیری مدل اندازه آزاد نامیده می شود که مارا از قید اندازه ها رها می کند. در این روش از برگشت های واریانس نمونه ای استفاده می شود.

کلمات کلیدی:

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/118966>

