

عنوان مقاله:

محاسبه ارزش در معرض خطر شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از مدل آرچ توانی متقاری و نامتقارن

محل انتشار:

پنجمین کنفرانس ملی اقتصاد، مدیریت و حسابداری (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 8

نویسندگان:

محمدحسین یونسی - دانشجوی کارشناسی ارشد علوم اقتصادی دانشگاه تهران

امیرحسین حاجیلو مقدم - دانشجوی کارشناسی ارشد علوم اقتصادی دانشگاه تربیت مدرس

سیدعبدالوحید محمودی - دانشجوی کارشناسی ارشد علوم اقتصادی دانشگاه تربیت مدرس

خلاصه مقاله:

هدف از این مطالعه، اندازه گیری ریسک با معیار سنجش ارزش در معرض خطر از طریق مدل آرچ توانی APARCH با توزیع های متقارن و نامتقارن برای شاخص کل سهام روزانه بورس اوراق بهادار تهران و مقایسه بین این توزیع ها است. برای دست یابی به این هدف، نخست ارزش در معرض خطر با استفاده از مدل APARCH طی دوره ۱۳۸۸/۰۷/۰۱ ال ۱۳۹۹/۰۷/۲۰ تخمین زده و سپس با استفاده از معیارهای پس آزمایی به مقایسه این توزیع ها پرداخته و سپس از نظر کفایت رتبه بندی شده است. نتایج آزمون های پس آزمایی نشان دهنده این است که مدل APARCH با توزیع تی چوله از نظر داشتن کم ترین تخطی نسبت به سایر توزیع ها برتری دارد.

کلمات کلیدی:

ارزش در معرض خطر، شاخص کل، مدل آرچ توانی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1234641>

