

عنوان مقاله:

بررسی ریسک صندوق های سرمایه گذاری در سهام با استفاده از مدل value at risk در بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

اولین کنفرانس ملی سرمایه گذاری جسورانه (تامین مالی و مدل های ارزیابی) (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 22

نویسندگان:

سمیه همتی - کارشناسی ارشد، مدیریت اجرایی گرایش بازار سرمایه، سازمان مدیریت صنعتی، تهران، ایران

بهنام چاوشی - دکترای مدیریت مالی، دانشگاه تهران، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

طی سال های اخیر، سنجش ارزش در معرض خطر از مقبولیت و محبوبیت خاصی نزد سرمایه گذاران و فعالین بخش مالی برخوردار بوده است. ارزش در معرض ریسک، روش جدیدی برای اندازه گیری و سنجش خطر احتمالی موجود در بازارهای مالی و از خانواده معیارهای ریسک نامطلوب می باشد که تا به حال در بسیاری از موسسات مالی نفوذ داشته و روش دست یابی آن ها را به میزان ریسک مالی خود، کاملاً تغییر داده است. ارزش در معرض که ریسک بازار را بصورت عددی بیان می کنند. جز مهمترین معیارهای اندازه گیری ریسک مبتنی بر روش های آماری در بازارهای مالی هستند. در این تحقیق، با استفاده از مدل GHARCH ارزش در معرض خطر (VaR) برای ۴۲ صندوق از صندوق های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران طی سال ۱۳۹۷ بطور روزانه که واریانس ناهمسانی شرطی در آن ها مشاهده می شود، برآورد گردید.

کلمات کلیدی:

ریسک، صندوق های سرمایه گذاری، ارزش در معرض خطر

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1359387>

