

## عنوان مقاله:

تخمین ارزش در معرض ریسک و ارزش در معرض ریسک شرطی با استفاده از مدل های مختلف

## محل انتشار:

سومین کنفرانس بین المللی نوآوری در مدیریت کسب و کار و اقتصاد (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

## نویسندگان:

زینب کشاورزی - دانشجوی دکترا حسابداری، دانشکده ادبیات و علوم انسانی، واحد یاسوج، دانشگاه آزاد اسلام می، یاسوج، ایران

فریبرز عوض زاده فتح - استادیار، دانشکده ادبیات و علوم انسانی، واحد گچساران، دانشگاه آزاد اسلامی، گچساران، ایران

طیبه خجسته - دانشجوی کارشناسی ارشد حسابداری، دانشکده ادبیات و علوم انسانی، واحد یاسوج، دانشگاه آزاد اسلام می، یاسوج، ایران.

## خلاصه مقاله:

هدف از انجام پژوهش حاضر، تخمین ارزش در معرض ریسک و ارزش در معرض ریسک شرطی با استفاده از مدل های مختلف می باشد. به منظور بررسی و پاسخ به سوالات پژوهش نمونه ای با استفاده از روش نمونه گیریحذفی سیستماتیک از بین شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران طی سال ۱۳۸۵-۱۳۸۹ انتخاب شده است. تحقیق حاضر به لحاظ هدف از نوع کاربردی، به لحاظ معرفت شناسی از نوع تجربه گرا، سیستماستدلال آن استقرایی و به لحاظ نوع مطالعه میدانی - کتابخانه ای است که از اطلاعات تاریخی به صورت علی پس رویدادی (یعنی استفاده از اطلاعات گذشته) استفاده می کند. در پژوهش حاضر برای محاسبه ارزش در معرضریسک، از روش پارامتریک واریانس-کوواریانس و با استفاده از سه الگوی نرمال، تی استیودنت و الگوی خطایتعممیمیافته استفاده شده است. نتایج تحقیق بیانگر این موضوع است که ریسک نقدینگی بیشترین سهم را در بینانواع ریسک های بازار داراست. همچنین نتایج تحقیق با استفاده از میانگین سه الگوی موردبررسی رتبه های یکتا چهار را به ترتیب به ریسک های اعتباری، عملیاتی، نقدینگی و بازار اختصاص داده است.

## کلمات کلیدی:

ریسک بازار، ریسک نقدینگی، ارزش در معرض خطر، بورس اوراق بهادار تهران

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1499153>

