

عنوان مقاله:

برآورد ریسک سرمایه گذاری در یک پرتفوی متشکل از ارز دیجیتال و فیات و بهینه سازی آن با استفاده از روش ارزش در معرض خطر

محل انتشار:

نهمین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع و سیستم ها (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

نویسندگان:

عباسعلی جعفری ندوشن - استادیار گروه مهندسی صنایع، دانشکده فنی و مهندسی دانشگاه میبد

فاطمه عظیمی حصاری - کارشناس ارشد مهندسی مالی، دانشکده فنی و مهندسی، دانشگاه میبد

زهرا رستگاری - کارشناس ارشد مهندسی مالی، دانشکده فنی و مهندسی، دانشگاه میبد

خلاصه مقاله:

اقتضای عصر حاضر توجه به تغییرات و پیشرفتهای و واکنش سریع و صحیح در مقابل هر یک از آنها میباشد، از جمله این تحولات، ظهور بازار ارزهای دیجیتال با تنوعی زیاد میباشد که سرمایه گذاری را پیچیده خواهد کرد و نه تنها سود بلکه ریسک زیان آن نیز زیاد خواهد بود، از جهتی دیگر سرمایه گذاری در ارزهای فیات بسیار کم ریسک و نیز متناسب با این ریسک، بسیار کم بازده میباشد بنابراین تحقیق حال حاضر با تشکیل پرتفویی به کمک روش ارزش در معرض خطر با داراییهایی مانند سه ارز دیجیتال بیتکوین، ریپل و استلار و سه ارز فیات دلار، یورو و فرانک توانسته است به این سوال پاسخ دهد که چگونه میتوان در ارزهای دیجیتال بازده بالاتر و با ارزهای فیات ریسک پایینتری را در سرمایه گذاری تجربه کرد. نتایج حاکی از آن است که برای رسیدن به بازده بالاتر در این پرتفوی نیاز به وزن بیشتری از ارزهای دیجیتالی همچون بیتکوین، ریپل و استلار میباشد و نیز سرمایه گذاری بر روی دلار نمیتواند پیشنهاد خوبی برای تشکیل این پرتفوی باشد. بنابراین پیشنهاد میشود از سرمایه گذاری صرف در هر یک از بازارهای ارز دیجیتال و ارز فیات خودداری کرده و با سرمایه گذاری در پرتفویی متشکل از داراییهای هر دوی این بازارها، بازده بالاتر را تجربه کرد.

کلمات کلیدی:

ارز دیجیتال، ارز خارجی، ارزش در معرض خطر، پرتفوی و ریسک.

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1772956>

