

عنوان مقاله:

برآورد ریسک شرطی با استفاده از حرکت براونی هندسی

محل انتشار:

شانزدهمین کنفرانس بین المللی انجمن ایرانی تحقیق در عملیات (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 6

نویسنده:

رفیع حسنی مقدم - استادیار اقتصاد، دامغان، دانشگاه دامغان، دانشکده ریاضی و علوم کامپیوتر، کدپستی ۳۶۷۱۵-۳۶۴

خلاصه مقاله:

با توجه به اینکه اوراق مورد مبادله در فرابورس کشور از نظر قیمت و بازدهی دارای عدم قطعیت است، بنابراین برای دارنده آن ریسک هایی در بر دارد. در این تحقیق با استفاده از یک فرآیند تصادفی (براونی)، مقدار ریسک انواع اوراق مورد مبادله در فرابورس، در قالب مدل ارزش در معرض ریسک شرطی و با استفاده از کد نویسی در نرم افزار متلب محاسبه شده و مشخص می شود به طور متوسط نمادهای مربوط به اوراق مشارکت بیشترین ریسک و بعد از آن نمادهای اجاره و مراحه دارای ریسک هستند.

کلمات کلیدی:

ارزش در معرض ریسک شرطی، فرآیند براونی هندسی، اوراق مالی، بازار سرمایه

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1920729>

