

عنوان مقاله:

تجزیه و تحلیل مدل حداقل واریانس جهت کنترل مخاطره مالی

محل انتشار:

سومین کنفرانس ریاضیات مالی و کاربردها (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 6

نویسندگان:

پرستو هیئتیان نائینی - دانشگاه پیام نور مرکز نائین

محمدرضا خدابخشیان نائینی - دانشگاه آزاد اسلامی واحد زواره

خلاصه مقاله:

کنترل مخاطره مالی نوعی از مهندسی سیستم پیچیده است. این پژوهش به مطالعه ی اعتبار پورتنوی سرمایه گذاری مدل میانگین واریانس تحت شرایط دوره ی سرمایه گذاری می پردازد. این مدل از طریق روش ضریب لاگرانژ مورد تجزیه و تحلیل قرار می گیرد و همچنین وزن پورتنوی حداقل واریانس کروی با وزن پورتنوی ترکیبی حداقل واریانس و حداکثر نسبت شارپ بیان می شود.

کلمات کلیدی:

مهندسی مالی، انتخاب پرتفو، مدل حداقل VAR، ضریب لاگرانژ، نسبت شارپ

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/352568>

