

عنوان مقاله:

تحلیل و مقایسه دو استراتژی بیمه سبد سرمایه (OBPI و CPPI) به وسیله معیار عملکرد امگا

محل انتشار:

سومین کنفرانس ریاضیات مالی و کاربردها (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 17

نویسندگان:

فهیمه الهی - دانشگاه غیرانتفاعی شیخ بهایی

مریم هاشمی - عضو هیئت علمی دانشگاه غیرانتفاعی شیخ بهایی

خلاصه مقاله:

در این مقاله، عملکرد دو روش عمده ی پوشش ریسک سبد سرمایه، استراتژی های پوشش ریسک سبد سرمایه بر پایه ی اختیار معامله OBPI و پوشش ریسک سبد سرمایه با نسبت ثابت CPPI تحلیل می شود. برای این نوع روش های بیمه ی سبد سرمایه، معیار عملکرد امگا به کار برده می شود که این معیار توزیع بازدهی کل را محاسبه می کند. مجموعهای از مقدارهای آستانه برای معیار عملکرد امگا در نظر گرفته می شود و نشان داده می شود که استراتژی CPPI عملکرد بهتری نسبت به استراتژی OBPI دارد. در انتها در غالب یک مثال عددی به بررسی دو روش مطرح شده می پردازیم.

کلمات کلیدی:

پوشش ریسک سبد سرمایه، نسبت امگا، پوشش ریسک سبد سرمایه بر پایه ی اختیار معامله (OBPI)، پوشش ریسک سبد سرمایه با نسبت ثابت (CPPI)

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/352572>

