

عنوان مقاله:

یکپارچگی، تصحیح خطا و مسئله میانگین- واریانس

محل انتشار:

سومین کنفرانس ریاضیات مالی و کاربردها (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

ریحانه ملکیان اصفهانی - دانشگاه شیخ بهایی اصفهان

مریم هاشمی - عضو هیئت علمی دانشگاه غیرانتفاعی شیخ بهایی

خلاصه مقاله:

در این پژوهش، مسئله ی انتخاب سبد سرمایه به روش میانگین- واریانس برای دارایی های یکپارچه (همجمع) بیان می شود. به این منظور در ابتدا سری های زمانی یکپارچه معرفی شده توسط اینگل و گرانجر (1987) ارائه و نمایش تصحیح خطا برای بردار سری های زمانی مطرح می شود. سپس با استفاده از تئوری نمایش گرانجر به بررسی ارتباط بین سری های یکپارچه و مدل تصحیح خطا پرداخته می شود. در انتها با استفاده از مدل گسته- زمان ارزش دارایی ها، یک مدل تصحیح خطای پویا برای سری زمانی مورد نظر بیان و بهینه سازی سبد سرمایه دارایی های یکپارچه با روش میانگین- واریانس مطرح می شود.

کلمات کلیدی:

یکپارچگی (همجمعی)، تصحیح خطا، تئوری سبد سرمایه میانگین-واریانس، تئوری نمایشگرانجر

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/352643>

