

عنوان مقاله:

استفاده از داده ها با فرکانس بالا به منظور برآورد ریسک سیستماتیک سبد دارایی: مطالعه موردی در بورس اوراق بهادار ایران

محل انتشار:

سومین کنفرانس ملی حسابداری، مدیریت مالی و سرمایه گذاری (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

محمد رکن الساداتی عز آبادی - استادیار گروه مهندسی مالی، دانشکده فنی و مهندسی، دانشگاه علم و فرهنگ

پریناز جلا - دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی مالی، دانشکده فنی و مهندسی، دانشگاه علم و فرهنگ

خلاصه مقاله:

در این تحقیق به برآورد ریسک سیستماتیک شرکت ملی صنایع مس ایران با استفاده از داده ها با فرکانس بالا در طیماه های خرداد الی آبان سال 1393 پرداخته شده است. امروزه در بازارهای جهانی نوع دیگری از داده ها، داده ها با فرکانس بالا حائز اهمیت هستند. هنگام استفاده از داده ها با فرکانس بالا خطاهایی تحت عنوان اختلالات کوچک در تجزیه و تحلیل های مربوط به برآورد ریسک سیستماتیک ایجاد می گردد. همچنین به منظور برآورد ماتریس کوواریانس نوسانات واقعی، ما از برآوردگر کرنل مبنای متقارن استفاده نمودیم. بنابراین ما در این تحقیق به برآورد ریسک سیستماتیک با دقت بیشتر و اریبی کمتر خواهیم پرداخت و در نتیجه در زمینه مدیریت ریسک پرتفوی و تخصیص دارایی ها به عملکرد بهتری خواهیم رسید.

کلمات کلیدی:

داده ها با فرکانس بالا، اختلالات کوچک، کرنل مبنای متقارن، ریسک سیستماتیک، نوسانات واقعی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/373033>

