

عنوان مقاله:

ارزش در معرض خطر با استفاده از شاخص سازی برای تعریف روابط میان دارایی ها در یک پورتفو

محل انتشار:

کنگره بین المللی مدیریت، اقتصاد و توسعه کسب و کار (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسندگان:

زهرا اسدی - دانشجوی کارشناسی ارشد، دانشکده مهندسی صنایع و مدیریت سیستمها، دانشگاه امیرکبیر

پژمان مهران - استادیار، دانشکده مهندسی صنایع و مدیریت سیستمها، دانشگاه امیرکبیر

خلاصه مقاله:

بورس اوراق بهادار به شدت تحت تأثیر عوامل غیر قابل پیش بینی محیط پر نوسان بازارهای مالی است. یک سرمایه گذار نیاز دارد این عوامل را بشناسد و تا حدودی پیش بینی کند تا به کمک آنها تصمیم های بهتری اتخاذ نماید. یک سیستم مناسب ارزش در معرض خطر به سرمایه گذاران اجازه مدیریت بهتر سبد دارایی ها با ارزیابی دقیق ریسک را خواهد داد. در نظر گرفتن روابط میان دارایی ها در یک سبد از عواملی است که پیچیدگی های محاسبه ارزش در معرض خطر را افزایش می دهد. در این پژوهش با ایجاد یک شاخص از دارایی های پورتفو و با استفاده از مدل های AR برداری و GARCH چند متغیره برای مدلسازی سری زمانی بازده دارایی ها، توانستیم دقت محاسبه ارزش در معرض خطر را افزایش دهیم.

کلمات کلیدی:

ارزش در معرض خطر، مدل AR برداری، GARCH چند متغیره، شاخص سازی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/440767>

