

عنوان مقاله:

اندازه گیری ریسک در طرح های سرمایه گذاری به وسیله الگوریتم مونت کارلو

محل انتشار:

کنفرانس جهانی مدیریت، اقتصاد حسابداری و علوم انسانی در آغاز هزاره سوم (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

نویسنده:

آرین اشراقی - دانشجوی کارشناسی ارشد دانشگاه صنعتی شریف

خلاصه مقاله:

ریسک در تمام جنبه های زندگی یک فرد، چه در حال مدیریت یک سازمان بزرگ باشد چه در زمانی که در حال عبور از خیابان می باشد وجود دارد. یکی از مهم ترین موارد ریسک، ریسک در طرح های سرمایه گذاری می باشد. مطالعات امکان سنجی یکی از روش های مرسوم در آنالیز کردن یک طرح سرمایه گذاری است. یکی از مراحل مهم در مطالعات امکان سنجی، بررسی ریسک یک طرح سرمایه گذاری می باشد. تجزیه و تحلیل ریسک، شامل شناسایی و تخمین زدن تاثیرات و سطح آن و نیز ایجاد اقدامات برای کاهش تاثیر منفی آنها می باشد. روش های مختلفی برای اندازه گیری ریسک تا امروز ارائه شده است. در این مقاله به بیان روش اندازه گیری ریسک به کمک الگوریتم مونت کارلو اقدام می کنیم. و از روش ارائه شده به وسیله بریاند و هیل در بکار بردن الگوریتم با کمک اکسل استفاده می کنیم و در ادامه برای نمونه با کمک این الگوریتم، به اندازه گیری ریسک طرح سرمایه گذاری که توسط علیرضا خواجه و همکارانش تحلیل اقتصادی آن انجام شده است، اقدام می کنیم.

کلمات کلیدی:

ریسک، ریسک در مطالعات امکان سنجی، الگوریتم مونت کارلو، پروژه های سرمایه گذاری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/524524>

