

## عنوان مقاله:

کاربرد مجانب مرتبه دوم مجموع ریسک لگاریتمی- بیضوی در دارایی و مقایسه با مجانب مرتبه اول

## محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی علوم پایه و تحقیقات بنیادی (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 6

## نویسندگان:

سیدهادی سیدین - هیأت علمی دانشگاه پیام نور استان اصفهان، ایران

میلاد عبدی

## خلاصه مقاله:

در این مقاله ما نرخ خطای تقریب مجانب مرتبه اول را برای احتمال انتهای مجموع خطاهای لگاریتم-بیضی ثابت میکنیم. رهیافت ما برخاسته از نظریه مقدار بی نهایی است که به ما این امکان را میدهد که تنها شرایط خفیف مجانبی را اعمال کنیم که به ویژه، توسط ریسکهای لگاریتمی-نرمال برآورده می شوند. با در نظر گرفتن محدوده وسیعی از کاربردهای مدل لگاریتم-نرمال در دارایی و بیمه، نتیجه ما مبتنی بر شبیهسازیهای رویداد-نادر و محاسبات عددی است. ما مثالهایی عددی را ارائه میکنیم که نشان میدهند که تقریب مرتبه دوم استخراج شده در این مقاله به طرز چشمگیری تقریب مرتبه اول را بهبود میبخشد.

## کلمات کلیدی:

تجمع ریسک. مجانب مرتبه دوم. توزیع لگاریتمی-بیضی. لگاریتمی-نرمال. ماکزیمم-حوزه جذب گامبل

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/548548>

