

## عنوان مقاله:

رویکرد برنامه ریزی پویای احتمالی استوار برای ارزش گذاری سبد اختیار معامله حقیقی

## محل انتشار:

هفتمین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع (سال: 1389)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

## نویسندگان:

حامد رحیمیان - دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی صنایع - صنایع

آبتین بوستانی - دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی صنایع - صنایع

محمد مدرس - استاد دانشکده مهندسی صنایع

## خلاصه مقاله:

تعیین ارزش پروژه های تحقیق و توسعه، با استفاده از ارزش گذاری اختیار معامله حقیقی رویکردی است که باعث ایجاد حاشیه اطمینان در مقابل ضررهای احتمالی و مقابله با کاهش ارزش بازده این پروژه ها می شود. در این رویکرد هم چنین می توان از افزایش احتمالی ارزش دارایی پایه منتفع گردید.

## کلمات کلیدی:

سبد دارایی های ریسکی، اختیار معامله حقیقی، عدم قطعیت، برنامه ریزی پویای احتمالی استوار

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/93477>

