

## عنوان مقاله:

مطالعات امکان سنجی بکارگیری فرمول حساسیت یونانی ها در بازار سرمایه ایران

## محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار، دوره 9، شماره 36 (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

## نویسنده:

سیاوش احمدی چهره برق - عضو هیات علمی دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران شمال

## خلاصه مقاله:

در این مقاله فرمول حساسیت یونانی ها در بازار سرمایه مورد بررسی قرار خواهد گرفت. هدف از این تحقیق امکان سنجی به کار گیری فرمول حساسیت یونانی ها در بورس تهران می باشد. این تحقیق از تحقیقات کاربردی و اطلاعات مالی ایران خودرو از مهر 95 تا اسفند 95 بررسی شده است. به منظور بررسی و تفسیر مفاهیم فرمول حساسیت یونانی نرم افزارهای آماری و ریاضی مانند MATLAB بهره گرفته و محاسبات با قوانین اختیار اروپای (مطابق بازار بورس تهران) انجام می شود. خروجی های به دست آمده نشان می دهد که میانگین و پراکندگی بدست آمده در نمونه انتخاب شده دارای توزیع نرمال نمیباشد و به کمک آزمون لون ثابت میشود که میتوانیم میانگین و پراکندگی نمونه بدست آمده را با ضریب اطمینان 99 درصد، جایگزین میانگین و پراکندگی جامعه نموده و از معادله بلک- شولز برای معرفی یونانی ها بهره برده و تاثیر هر یک از متغیرها را بررسی می نماییم. خروجی های بدست آمده نشان می دهد که پارامترهای قیمت سهام، پراکندگی، زمان سررسید، ضریب بهره در قیمت اختیار خرید تاثیر داشته و برای کاهش ریسک در بازار بورس معرفی یک مدل ریاضی و ضرایب حساسیت یونانی از قبیل دلتا، رو، وگا، تتا و گاما لازم بوده و استفاده از ضرایب حساسیت یونانی در بورس تهران و آشنا نمودن سرمایه گذاران با مفاهیم ریاضیات مالی ضروری می باشد.

## کلمات کلیدی:

فرمول حساسیت یونانی، آزمون فرضیه، اختیار اروپایی، مقدار زمانی و ذاتی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/958547>

