

عنوان مقاله:

مقایسه توان تبیین مدل های پارامتریک (اقتصادسنجی) و شبکه عصبی در سنجش میزان ارزش در معرض خطر پرتفوی شرکت های سرمایه گذاری جهت تعیین پرتفوی بهینه در بازار سرمایه ایران

محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار، دوره 5، شماره 21 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 21

نویسندگان:

غلامرضا زمردیان - دکتری و عضو هیئت علمی دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران مرکز

علی رستمی - استادیار علوم انسانی دانشگاه پیام نور

مهدی کریمی زند - عضو هیئت علمی مدیریت بازرگانی دانشکده مدیریت دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران مرکز

خلاصه مقاله:

در دنیای پیچیده ای که ریسک جز لاینفک سرمایه گذاری ها گشته و برای سرمایه گذاری در هر جا ابتدا می بایست ریسک آن را محاسبه نمود و در اختیار سرمایه گذار قرار داد تا وی به این نتیجه برسد که در مکان مورد نظر سرمایه گذاری نماید یا خیر! محاسبه ریسک معنی و مفهوم پیدا می کند. بنابراین برای پاسخ گویی به سرمایه گذار روش های متفاوتی با توجه به نوع داده های تخمین زننده پارامترهای مدل های تبیین کننده ریسک طراحی و پا به عرصه وجود گذاشته اند. در میان این مدل ها دو گروه از مدل های اقتصاد سنجی و شبکه عصبی در این تحقیق مورد بررسی قرار می گیرند تا توان این دو گروه را در پیش بینی ارزش در معرض خطر پرتفوی 21 شرکت های سرمایه گذاری در بازار سرمایه ایران مورد سنجش قرار گیرد و مدل برتر معرفی شود.

کلمات کلیدی:

ریسک، بازده، پرتفوی، ارزش در معرض خطر، شرکت های سرمایه گذاری، روش پارامتریک، شبکه عصبی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/958713>

