

عنوان مقاله:

مقایسه کارایی مدل های ارزش در معرض ریسک در بورس اوراق بها دار تهران

محل انتشار:

کنفرانس ملی آینده پژوهی، مدیریت و توسعه پایدار (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 23

نویسندگان:

فهیمة جناقی باف - کارشناس ارشد مدیریت بازرگانی گرایش مالی، دانشگاه ارشاد دماوند واحد تهران، ایران.

محمداسماعیل فدایی نژاد - دانشیار گروه مدیریت مالی، دانشگاه شهید بهشتی، تهران، ایران.

خلاصه مقاله:

در این تحقیق به ارزیابی عملکرد روشهای مختلف محاسبه ارزش در معرض خطر در بازار بورس تهران پرداخته ایم. برای این منظور از رویکردهای مهم و معروف موجود برای محاسبه ارزش در معرض خطر، اعم از پارامتریک و ناپارامتریک، در سطوح اطمینان و اندازه های نمونه مختلف بهره برده ایم. به منظور مقایسه این روشها با یکدیگر از یک رویکرد پس آزمایی مبتنی بر رتبه بندی بر اساس تابع زیان نظارتی استفاده نموده ایم. نتایج به دست آمده از آزمون تجربی مدلها بر روی داده های شاخص تهران نشان میدهد که مدل های پارامتریک خانواده GARCH با اثرات اهرمی یا نامتقارن با توزیع پسماندهای t بهترین عملکرد را در بین سایر مدل های استفاده شده دارا میباشند.

کلمات کلیدی:

ارزش در معرض خطر، بازار بورس تهران، پس آزمایی.

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/987579>

