

عنوان مقاله:

تخمین و پیش بینی معیار ریسک پورتفوی (CVaR) در صنایع مختلف بازار بورس ایران

محل انتشار:

سیزدهمین کنفرانس بین المللی انجمن ایرانی تحقیق در عملیات (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

نویسندگان:

امیررضا عبدالله نژاد - دانشجوی کارشناسی ارشد، دانشگاه صنعتی امیرکبیر تهران

احسان حاجی زاده - استادیار دانشکده مهندسی صنایع، دانشگاه صنعتی امیرکبیر تهران

خلاصه مقاله:

هدف از این تحقیق، محاسبه و پیش بینی ریسک صنایع مختلف در بازار بورس تهران می باشد. لذا بدین منظور، با استفاده از مدل های ساخت پورتفوی سهام و استفاده از معیار CVaR در بورس تهران، پورتفوی سرمایه گذاری در صنایع مختلف در بازه های زمانی متنوع تشکیل شده است. سپس با استفاده از مدل های سری زمانی در مسائل مالی تابع پیش بینی بر اساس هر مدل و معیار ریسک تشکیل و خروجی هر یک از مدل ها جمع آوری شده است. با مقایسه مقادیر واقعی آینده ضمن بررسی بازدهی واقعی پورتفو نسبت به عملکرد مورد انتظار میزان کارایی و بهبود داده شده در عملکرد سبد مورد بررسی قرار داده شده است. عملکرد مدل های پیش بینی سری زمانی مالی و انتخاب بهترین مدل پیش بینی کننده بر اساس فاصله داده های آینده و پیش بینی شده بررسی و منجر به انتخاب بهترین مدل با توجه به نتایج معرفی شده است و در نهایت عملکرد کلی سری های زمانی در پیش بینی نتایج مورد سنجش قرار گرفته است.

کلمات کلیدی:

بهینه سازی سبد سرمایه گذاری سری های زمانی پیش بینی؛ حداقل سازی ریسک

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1124921>

