

## عنوان مقاله:

ارزش در معرض خطرمدلسازی GARCH و پیش بینی نوسان شرطی بازدهی پوشش ریسک سرمایه

## محل انتشار:

نهمین کنفرانس بین المللی مهندسی صنایع (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

## نویسندگان:

محمدتقی جهاننیده - استادیار صنعتی اصفهان

مریم عطایی - دانشجوی کارشناسی ارشد امار

## خلاصه مقاله:

ارزش در معرض خطر بیانگر حداکثر زیان مورد انتظار بر روی سبد سرمایه در طول افق زمانی معین در شرایط عادی بازار و در سطح اطمینان معین می باشد که با ارزش در معرض خطر معمولی نشان می دهیم ارزش در معرض خطر در مدیریت ریسک دارای کاربرد فراوان است و یکی از مهمترین مفاهیمی است که بطور گسترده در مدیریت ریسک توسط موسسات مالی مورد استفاده قرار میگیرد بدلیل چولگی و دم سنگینی توزیع بازدهی مالی روزانه ارزش در معرض خطر معمولی برای پوشش ریسک سرمایه برآورد صحیحی نیست در عین حال با در نظر گرفتن نوسان شرطی متغیر با زمان مدل دیگری به نام ارزش در معرض خطر نوع GARCH یک ابزار اندازه گیری بهتر برای محاسبه ریسک تجارت های استراتژیک است و برای ترسیم فرایند واقعی بازدهی موثرتر است در این مقاله نوسان تغییر پذیر با زمان را در ارزش در معرض خطر پیاده و چولگی و کشیدگی آن را کنترل می نماییم پیش بینی نوسان نه تنها در مدیریت ریسک سرمایه های پوششی بلکه در زمینه ی سبدهای سرمایه پوششی نیز حائز اهمیت است.

## کلمات کلیدی:

ریسک، مدیریت ریسک، سرمایه های پوششی، ارزش در معرض خطر، مدلسازی GARCH پیش بینی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/189154>

