



## برآورد کسری مورد انتظار پرتفوی بر اساس تابع مفصل و رویکرد

### *POT – GARCH*

علیزاده، ف. <sup>۱</sup> و محتشمی برزادران، غ. <sup>۲</sup>

<sup>۱،۲</sup> گروه آمار، دانشکده علوم ریاضی، دانشگاه فردوسی مشهد

#### چکیده

ریسک یکی از مفاهیم پایه ای در بازارهای مالی می باشد و اندازه گیری و تحلیل آن اهمیت بسزایی دارد. در این مقاله برآورد یکی از مهم ترین روش های اندازه گیری ریسک یعنی کمبود مورد انتظار در یک پرتفوی شامل دو دارایی وابسته بر اساس تابع مفصل و استفاده از رویکرد فراتر از آستانه مطالعه می شود و سپس آن را در یک پرتفوی شامل دو دارایی از سهام شرکت *IBM* و *SP* برآورد می کنیم.

**کلمات کلیدی:** بازارهای مالی، ریسک، دارایی وابسته

<sup>۱</sup> fateme.alizade301073@gmail.com