



تاریخ:

شماره:

جلسه دفاع از پایان نامه کارشناسی ارشد (یا رساله دکترا) رشته: آمار اقتصادی

عنوان پایان نامه یا رساله: اندازه های مخاطره و تغییرپذیری بر مبنای ضریب جینی

ارائه دهنده: خانم زهرا عبدالله زاده

استادان راهنما: جناب آقای مجید اسدی ،

استادان مشاور: سرکار خانم سمیه اشرفی و ونوسفادرانی ،

تاریخ: ۱۴۰۴/۰۷/۳۰، ساعت: ۱۰:۰۰-۱۲:۰۰، مکان جلسه:

نام دانشکده و گروه: ریاضی و آمار آمار

چکیده: در مدیریت مدرن مخاطره، تعداد متنوعی معیار برای اندازه گیری مخاطره معرفی شده است. این معیارها نگاهی از مجموعه ای از متغیرهای تصادفی (زیان های مالی) به اعداد حقیقی هستند. معیارهای مخاطره ابزارهایی هستند که برای سنجش میزان زیان احتمالی در شرایط نامطلوب مالی یا اقتصادی به کار می روند. این معیارها مانند ارزش در معرض خطر (VaR) و کسری مورد انتظار (ES)، تمرکز خود را بر بخش های دم توزیع زیان ها قرار می دهند، اما اغلب تغییرپذیری درون آن دم را نادیده می گیرند. تابع جینی دمی با تمرکز بر تفاوت های زوجی و بدون وابستگی به مرکز توزیع، معیار قدرتمندی برای سنجش تغییرپذیری و نابرابری در داده ها است. در حوزه مخاطره، این تابع با کمک انتگرال چوکت که معیارهای تغییرپذیری را بهتر توصیف می کند، امکان مدل سازی دقیق تر مخاطره های دمی را فراهم می کند و پایه ای برای توسعه معیارهای ترکیبی مانند کسری جینی است که هم شدت و هم پراکندگی زیان های شدید را در نظر می گیرد. برای در نظر گرفتن رفتارهای کلی تر در تحلیل مخاطره دم توزیع، نسخه ای تعمیم یافته از معیار کسری جینی معرفی می شود. این معیار مخاطره که کسری جینی تعمیم یافته (EGS) نام دارد، مفاهیم تغییرپذیری را در بر می گیرد، ویژگی جمع پذیر هم یکنوا را داراست و تحت یک شرط لازم و کافی برای پارامتر وزن دهی، منسجم است. در نظر گرفتن مخاطره گریزی فرد در کنار این ویژگی ها، با آنچه افراد در جستجوی یک معیار مناسب مخاطره به دنبال آن هستند، هم راستا است. هدف این مطالعه معرفی یک معیار مخاطره جدید به نام کسری جینی و کسری جینی تعمیم یافته است که معیارهای نوع جینی برای مخاطره و تغییرپذیری را توسعه می دهد. این معیار مخاطره، منسجم بوده و تغییرپذیری را که مفهومی مهم در مدیریت مخاطره است، در بر می گیرد.