

عنوان مقاله:

سنجش کارایی اطلاعاتی بازار سرمایه ایران بر مبنای داده های روزانه ی شاخص قیمت و بازده نقدی

محل انتشار:

ششمین همایش ملی پژوهش های نوین در حوزه علوم انسانی، اقتصاد و حسابداری ایران (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

نویسندگان:

مهرناز سبیل پور - گروه حسابداری، دانشکده علوم انسانی، واحد تهران غرب، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

زهره هنرمندی - گروه حسابداری، دانشکده علوم انسانی، واحد تهران غرب، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

سمیرا زارعی - گروه حسابداری، دانشکده علوم انسانی، واحد تهران غرب، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

بازار سرمایه زمانی می تواند نقش حیاتی را در ساز و کار و رشد اقتصادی ایفا کند که فرآیند عرضه و تقاضای منابع مالی آن از تخصیص بهینه برخوردار باشد. از آنجا که پیش شرط اصلی تخصیص بهینه منابع در بازار سرمایه کارایی عملکرد آن است، نقش و جایگاه کارایی بازار سرمایه اهمیت به سزایی دارد. هدف تحقیق حاضر آن است که با بکارگیری آزمون ریشه واحد و آزمون ARCH-GARCH کارایی اطلاعاتی بورس اوراق بهادار تهران را در سطح ضعیف طی سال های 1390 الی 1397 با استفاده از داده های روزانه شاخص قیمت و بازده نقدی مورد سنجش قرار دهد.

کلمات کلیدی:

کارایی بازار سرمایه، ارزش ذاتی، سطح ضعیف کارایی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1117432>

