

عنوان مقاله:

شبیهسازی قیمت سهام از منظر عوامل داخلی و خارجی موثر بر سیستم با استفاده از رویکرد پویابیشناسی سیستمی

محل انتشار:

مدیریت دارایی و تامین مالی، دوره 4، شماره 4 (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 21

نویسندگان:

محمد هاشم موسوی حقیقی - مرکز تحقیقات کشاورزی و منابع طبیعی استان فارس

مجتبی خلیفه - میدان ارم، دانشگاه شیراز، دانشکده اقتصاد و مدیریت، بخش مدیریت

بهزاد صفایی - مدیریت سیستمها بخش مدیریت دانشکده اقتصاد و مدیریت دانشگاه شیراز، شیراز، ایران.

حامد صابری - مدیریت سیستمها بخش مدیریت دانشکده اقتصاد و مدیریت دانشگاه شیراز، شیراز، ایران.

خلاصه مقاله:

موسوی و ستوده (۱۳۹۲) رفتار قیمت سهام صنایع ملی مس ایران را در بازار بورس از منظر خارجی شبیهسازی کرده اند. الگوی این پژوهش از نتایج این مطالعه حاصل شده و امکان پیشبینی و تحلیل نوسان های آینده قیمت این سهم و همچنین ارزش ذاتی سهام را برای سیاستگذاران و صاحبان منافع (از منظر عوامل داخلی و خارجی) فراهم کرده است. برای الگوسازی رفتار سهم، عوامل اثرگذار بر قیمت سهم در بورس اوراق بهادار و عوامل موثر در قیمت محصول شرکت در بازار، شناسایی و نمودارهای علی و معلولی هر بخش براساس روششناسی پویاییهای سیستم ترسیم شده است. متغیرهای مالی در سه بخش قیمتگذاری، قیمت و تامین مالی از طریق بدهی بررسی شده است. الگوی سیستمی پژوهش با استفاده از این رویکرد و با نرمافزار Vensim DSS شبیهسازی و تحلیل شده است. نتایج نشان می دهد عرضه سهم، در بخش قیمت سهم، بیشترین تاثیر و تامین مالی از طریق بدهیها، در قیمت ذاتی سهم اثرگذاری مثبت دارد.

کلمات کلیدی:

پویایی های سیستم، قیمت سهام، ارزش ذاتی سهام، بازار سرمایه، صنایع ملی مس ایران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1288286>

