

عنوان مقاله:

الگو سازی حساب های سوداگرانه بازار سهام تهران با در نظر گرفتن پویایی های روانی و اجتماعی

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد و الگو سازی (اقتصاد سابق), دوره 8, شماره 30 (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 28

نویسندگان:

تیمور محمدی - گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد، دانشگاه علامه طباطبائی

داوود دانش جعفری - گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد، دانشگاه علامه طباطبائی

مصطفی نصرافهانی - گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد، دانشگاه علامه طباطبائی

خلاصه مقاله:

بازار سهام یکی از مهم ترین بازارهای مالی هر اقتصادی به حساب می آید و لذا فهم هرچه بیشتر آن برای سیاست گذاری ها لازم است. بسیاری از مطالعاتی که در مورد حساب بازار سهام تهران انجام گرفته اند با استفاده از روش های اقتصاد متعارف بوده اند، و لذا هیچ کدام اقدام به الگوسازی نظری نکرده اند. این پژوهش از رهیافت اقتصاد محاسباتی مبتنی بر عامل برای الگو سازی استفاده کرده است. نتایج نشان می دهند که وجود نااطمینانی در مورد تغییرات آتی قیمت از یک سو و انتظارات ناهمگن و پویایی های روانی و اجتماعی معامله گران از سوی دیگر، می تواند شکل گیری حساب سوداگرانه در بازار سهام تهران را توضیح بدهد. الگوی طراحی شده در این پژوهش با توجه به سادگی و پایه ای بودن، می تواند به عنوان زیربنایی محکم برای کارهای پیچیده تر در الگو سازی مبتنی بر عامل بازارهای مختلف استفاده شود. در این پژوهش الگو سازی تجربی برای شاخص کل بازار سهام در دوره ۱۳۹۲-۱۳۹۵ انجام گرفته است. ازجمله نتایج تجربی، افزایش سرعت یادگیری معامله گران از شهریور ۱۳۹۲ تا بهار ۱۳۹۵ است.

کلمات کلیدی:

اقتصاد محاسباتی مبتنی بر عامل، انتظارات ناهمگن، بازار سهام تهران، پویایی های روانی و اجتماعی، حساب

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1301458>

