

## عنوان مقاله:

تاثیر آماری عوامل موثر بر بازده شاخص بورس اوراق بهادار تهران

## محل انتشار:

هشتمین کنفرانس بین المللی مدیریت، حسابداری و توسعه اقتصادی (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

## نویسندگان:

رضا مومنی - عضو هیات علمی گروه آمار، دانشگاه زابل

امید شجاعی - عضو هیات علمی گروه آمار، دانشگاه زابل

## خلاصه مقاله:

بورس اوراق بهادار به عنوان نهادی اقتصادی تاثیر پذیری زیادی از چرخه های اقتصادی و مالی دارد و نیز اشخاص حقیقی یا حقوقی که در این رشته فعالیت دارند، برای حفظ و همچنین افزایش سبد سرمایه گذاری خود نیاز مبرم به دانستن عوامل موثر و تاثیرگذار بر روی این پدیده اقتصادی دارند. از اینرو، هدف از انجام تحقیق حاضر بررسی اثر عوامل کلان اقتصادی بر بازده سهام شرکتهای پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران است. در این تحقیق متغیرهای کلان اقتصادی به عنوان متغیرهای مستقل و بازده سهام نیز به عنوان متغیر وابسته و متغیرهای سودآوری نیز به عنوان متغیرهای کنترلی در نظر گرفته شده اند. برای آزمون فرضیه های تحقیق، اطلاعات مالی مربوط به شرکتهای بورس اوراق بهادار تهران که در سالهای مذکور فعالیت گستره ای داشته اند، انتخاب شده سپس مدل آماری بهینه خودرگرسیو ناهمسان واریانس شرطی تعمیم یافته GARCH بر روی آنها برازش داده شده است. نتایج نشان می دهد که فرضیه های تحقیق مبنی بر وجود رابطه معنادار بین متغیرهای کلان اقتصادی با شاخص کل سهام شرکت های فعال، پذیرفته شده می باشد.

## کلمات کلیدی:

شاخص کل، بورس اوراق بهادار، متغیرهای کلان اقتصادی، مدل GARCH

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1444735>

