

عنوان مقاله:

بررسی و طراحی مکانیزم سرریز ریسک در بازار بورس تهران؛ مطالعه موردی گروه فلزات اساسی

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی جهش علوم مدیریت، اقتصاد و حسابداری (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسنده:

رضا فروتن - دانشآموخته کارشناسی ارشد، مدیریت کسب و کار (MBA) گرایش مالی، دانشکده صنایع، دانشگاه صنعتی خواجه نصیرالدین طوسی، تهران

خلاصه مقاله:

پژوهش حاضر مکانیزم سرریز ریسک را بین گروه فلزات اساسی و ۲۱ گروه دیگر از بازار بورس تهران در بازه فروردین ۱۳۹۳ تا بهمن ۱۳۹۸ بررسی می نماید. در این پژوهش، برای محاسبه ارزش در معرض ریسک از روش پارامتریک-نرمال استفاده شده، و آزمون علیت گرانجر (وقفه های ۱ الی ۵) برای بررسی وجود سرریز ریسک به کار گرفته شده است. نتایج نشان می دهد که به فاصله یک روز از وقوع ریسک، سرریز ریسک از مبدا گروه فلزات اساسی به ۱۱ گروه، و در جهت عکس از مبدا ۱۶ گروه به آن، برقرار است. همچنین سرریز پایدار ریسک تا ۵ روز پس از وقوع ریسک، از مبدا گروه فلزات اساسی به مقصد گروه های «استخراج کانه های فلزی»، «لاستیک و پلاستیک»، «ساخت محصولات فلزی» و «محصولات شیمیایی»، و در جهت عکس از مبدا گروه های «استخراج کانه های فلزی»، «شرکت های چند رشته ای صنعتی»، «کاشی و سرامیک» و «سیمان آهک و

کلمات کلیدی:

سرریز ریسک، بازار بورس تهران، آزمون علیت گرانجر، ارزش در معرض ریسک، روش پارامتریک-نرمال

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1463500>

