

## عنوان مقاله:

تحلیل داده های بورس بر اساس تابع مفصل

## محل انتشار:

دوفصلنامه اندیشه آماری، دوره 26، شماره 1 (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

## نویسندگان:

سیده آزده فلاح مرتضی نژاد - Ferdowsi University of Mashhad

غلامرضا محتشمی برزادران - Ferdowsi University of Mashhad

بهرام صادقیور گیلده - Ferdowsi University of Mashhad

محمد امینی - Ferdowsi University of Mashhad

## خلاصه مقاله:

تابع مفصل یک ابزار مفید در شناسایی ساختار وابستگی داده های وابسته و در نتیجه برازش یک توزیع توام مناسب به داده ها می باشد. در این مقاله با استفاده از تابع مفصل داده های بورس شامل سه متغیر ضعف مالی، سود انباشته، و دارایی ملموس مربوط به ۱۱۰ شرکت تجاری ایران از سال ۱۳۸۵ تا ۱۳۸۹ تحلیل می شود و به خصوص یک توزیع سه بعدی به این داده ها برازش شده است. برای بررسی نوع وابستگی بین داده ها از ابزارهای مختلفی از جمله نمودار پراکنش، نمودار کای، و نمودار کندال استفاده نمودیم. همچنین اندازه وابستگی جهت دار و دمی داده ها را مورد بررسی قرار می دهیم و ضرایب وابستگی کندال و اسپیرمن را نیز محاسبه می کنیم. در انتها آزمون نیکویی برازش برای چند مفصل معروف را انجام دادیم تا بتوانم مفصل مناسب داده های بورس مقاله به دست آوریم.

## کلمات کلیدی:

Copula function, directional and tail dependency, chi and Kendall plot, تابع

مفصل: وابستگی جهتی و دمی: نمودار کای و کندال

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1514390>

