

عنوان مقاله:

تاثیر حملات تروریستی داخلی بر بازار بورس تهران

محل انتشار:

فصلنامه مطالعات مدیریت، مالی و اقتصادی، دوره 4، شماره 1 (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

زهرا بالستانی - مدیریت و حسابداری، پردیس فارابی، دانشگاه تهران، تهران

سارا محمدزاده - کارشناسی ارشد اقتصاد نظری، دانشگاه تربیت مدرس، تهران

خلاصه مقاله:

حوادث تروریستی در سالهای اخیر در نقاط مختلف جهان افزایش یافته است. تروریسم علاوه بر تلفات انسانی، تاثیرات پیچیده ای بر اقتصاد و بازارهای مالی به ایجاد می کند. ایران با توجه به موقعیت سیاسی و منطقه ای بارها مورد حملات تروریستی واقع شده است. ما در این مقاله به بررسی تاثیر ۱۶ حمله تروریستی که در نقاط مختلف ایران به وقوع پیوسته، روی بورس تهران می پردازیم. بازه زمانی این مطالعه بین سال های ۱۳۸۸-۱۳۹۹ است. داده های سری زمانی مربوط به شاخص بورس اوراق بهادار تهران از مرکز پردازش اطلاعات مالی ایران جمع آوری گردیده است. به منظور ارزیابی فرضیات تحقیق از مدل های ARCH و GARCH استفاده شده است. ابتدا برای بررسی مانایی متغیرها از آزمون های دیکی-فولر تعمیم یافته و فیلیپس-پرون استفاده شده که در این آزمون ها فرضیه صفر مبنی بر نامانایی متغیرها است. نتیجه اینکه متغیر حوادث تروریستی بر بازده شاخص کل تاثیر معنا داری دارد و منجر به کاهش شاخص کل می شود اما بر حجم معاملات تاثیر معنا داری ایجاد نمی کنند.

کلمات کلیدی:

: بورس اوراق بهادار، حوادث تروریستی، گارچ

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1523423>

