

## عنوان مقاله:

تجزیه و تحلیل مقایسه ای شاخص کل و شاخص صنایع غذایی: بورس اوراق بهادار تهران

## محل انتشار:

سومین کنفرانس بین المللی چالش ها و راهکارهای نوین در مهندسی صنایع، مدیریت و حسابداری (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 8

## نویسندگان:

سیده سمیرا کمال موسوی - دانشجوی کارشناسی ارشد، گروه اقتصاد کشاورزی، دانشکده مهندسی زراعی، دانشگاه علوم کشاورزی و منابع طبیعی ساری

فواد عشقی - استادیار گروه اقتصاد کشاورزی، دانشکده مهندسی زراعی، دانشگاه علوم کشاورزی و منابع طبیعی ساری

سیدمجتبی مجاوریان - دانشیار گروه اقتصاد کشاورزی، دانشکده مهندسی زراعی، دانشگاه علوم کشاورزی و منابع طبیعی ساری

## خلاصه مقاله:

بازار سهام برای ایجاد و توسعه یک اقتصاد قوی و رقابتی بسیار مهم و کلید تحولات ساختاری در هر اقتصادی است. بنابراین، درک رفتار پویای بازارهای سهام برای تحلیل گران مالی، اقتصاددانان کلان و سیاستگذاران ضروری است. برخلاف سایر منابع داده، بررسی قیمت سهام امکان تخمین عواقبیک رویداد را بدون نیاز به دوره‌های طولانی مشاهده فراهم میکند؛ به علاوه، شاخص سهام اطلاعات لازم از احساسات بازار را به سرمایه گذاران میدهد. تجزیه و تحلیل شاخص سهام یک موضوع محبوب و مهم در مطالعات مالی و دانشگاهی است که محققین آن را یک جنبه ضروری در بازارهای مالی و برای مدیریت ریسک مالی، امری حیاتی می‌شمرند. علاوه بر این تحلیل رفتار بازارهای سهام منجر به امکان شناسایی فرصت های جذاب برای کسب سود (بازده) قابل توجه میشود. این پژوهش از نظر طبقه بندی بر مبنای هدف از نوع پژوهشهای کاربردی است. آنالیز و معرفی الگوی رفتاری شاخص کل و شاخص صنایع غذایی باتکیه بر آزمونهای ریشه واحد و روش باکس-جنکینز انجام شده است. علاوه بر ارائه ی الگوی مناسب پیشبینی بررسی متغیر شاخص صنایع غذایی به موازات متغیر شاخص کل، امکان قیاس ماهیت و تفاوت های رفتار متغیرها را فراهم میکند. داده های روزانه ی مورد نیاز در قلمرو زمانی اول فروردین ۱۳۹۷ تا پایان اسفند ۱۴۰۰ با تکیه بر پایگاه اطلاعاتی بورس ایران گردآوری شده است. نتایج حاکی از آن است که خروجی مدل بهینه برای شاخص کل و شاخص صنایع غذایی و در نتیجه رفتار این دو سری در طول زمان یکسان نیست.

## کلمات کلیدی:

بورس اوراق بهادار تهران؛ مدل های آریمای؛ آزمون ریشه واحد؛ پیشبینی.

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1564937>

