

## عنوان مقاله:

کاربرد تابع مفصل در مدیریت ریسک بازار سهام: بورس اوراق بهادار تهران

## محل انتشار:

دومین کنفرانس بین المللی مدیریت، کارآفرینی و توسعه اقتصادی (سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

## نویسندگان:

منصور زراء نژاد - استاد و عضو هیئت علمی دانشگاه شهید چمران اهواز

علی کارگربرزی - دانشجوی کارشناسی ارشد دانشگاه شهید چمران اهواز

## خلاصه مقاله:

بورس اوراق بهادار یکی از ارکان اصلی بازار سرمایه در ایران است. اطلاع در مورد عوامل مؤثر بر بورس اوراق بهادار به سرمایه گذاران برای افزایش بازده و کاهش ریسک سهام کمک زیادی میکند. نرخ تورم یکی از عوامل اثرگذار بر بورس اوراق بهادار است. توابع مفصل رابطه بین متغیرها را همانگونه که هست، تصریح و تحلیل می کند. این توابع از طریق توزیع های حاشیه ای و اتصال و ارتباط آنها با تابع توزیع مشترک، وابستگی بین متغیرها را مورد ارزیابی قرار می دهند. از آنجا که این روش، وابستگی بین متغیرها را در مقادیر ماکزیمم یا مینیمم داده ها مورد بررسی قرار می دهد، در مدیریت ریسک بازار سهام بسیار قابل استفاده و حائز اهمیت است. هدف این تحقیق بررسی تأثیر نرخ تورم بر شاخص قیمت سهام 1932 در بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از توابع مفصل طی دوره زمانی 1376/10/1 تا 1390/1/1 است. نتایج اولیه تحقیق نشان داده است که بین نرخ تورم و شاخص قیمت سهام وابستگی دنباله ای همزمان بالا و پایین معنی داری وجود دارد؛ به این معنی که در مقادیر حدی، شاخص قیمت سهام به شدت به نرخ تورم وابسته است و لازم است که در تحلیلهای ریسک بازار سهام، به نرخ تورم توجه جدی داشت.

## کلمات کلیدی:

نرخ ارز، نرخ تورم، شاخص قیمت سهام، بورس اوراق بهادار، تابع مفصل، وابستگی دنباله طبقه بندی JEL: C51، G10، G32

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/286355>

