

## عنوان مقاله:

بهینه سازی و تصریح مدل تعیین قیمت سهام در بورس تهران

## محل انتشار:

کنفرانس بین المللی جهت گیری های نوین در مدیریت، اقتصاد و حسابداری (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

## نویسندگان:

رؤیا سیفی پور - عضو هیات علمی دانشکده اقتصاد و حسابداری، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد تهران مرکزی

نجات نظری - دانشجوی کارشناسی ارشد، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد تهران مرکزی

محمد ماهیدشتی - دانشجوی دکترای اقتصاد، دانشگاه بوعلی سینا

## خلاصه مقاله:

در این پژوهش بر اساس بررسی ادبیات موضوع داخلی و خارجی درباره ی عوامل تعیین کننده ی قیمت سهام، یک مدل اقتصاد ریاضی بهینه سازی و ضرایب متغیرهای توضیحی بر اساس آن تعیین علامت می شوند. سپس با انتخاب نمونه ای از حداقل 300 شرکت تولیدی از هشت گروه صنایع پذیرفته شده در بورس تهران در سال های 1391 و 1392، پراکنش داده ها بررسی و مدل تصریح می شود. مدل در سال 1391 تأیید می کند که حداقل 33 درصد از تغییرات قیمت سهام در بورس تهران توسط یک رگرسیون معنادار، بدون مشکل واریانس ناهمسانی، با متغیرهای مستقل سود، سود انباشته، خالص جریان نقدی و اهرم بعدی توضیح داده می شود.

## کلمات کلیدی:

بورس تهران، قیمت سهام، اقتصاد ریاضی، بهینه سازی، تصریح آماری

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/454721>

