

عنوان مقاله:

بررسی تاثیر نرخ سود بانکی بر شاخص بازار سهام

محل انتشار:

اولین همایش بین المللی انسجام مدیریت و اقتصاد در توسعه شهری (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

علیرضا کرمی - دانشکده فنی مهندسی، مهندسی صنایع - مهندسی مالی، موسسه آموزش عالی مهرالبرز

مسعود بهاری - دانشکده فنی مهندسی، مهندسی صنایع - مهندسی مالی، موسسه آموزش عالی مهرالبرز

خلاصه مقاله:

بخش قابل توجهی از دارایی های مالی در قالب سیستم بانکی به صورت سپرده های بلندمدت و کوتاه مدت سرمایه گذاری می شود که بانک ها با بهره گیری از این سپرده ها در فعالیتهای تولیدی سرمایه گذاری می کنند. این تحقیق به بررسی ارتباط نرخ بهره، و شاخص سهام اوراق بهادار تهران با استفاده از اطلاعات سالهای 1385 الی 1394 می پردازد. برای این منظور از مدل رگرسیونی (VAR) استفاده شده است. بدین منظور در ابتدا به بررسی مانایی مدل برآورد شده، پرداخته و در انتها به بررسی واکنش متغیرها نسبت به شوک و تجزیه واریانس پراخته خواهد شد.

کلمات کلیدی:

بهره، اندازه بهره، بازده سهام، نوسانات قیمت

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/563272>

