

عنوان مقاله:

بررسی سقوط قیمت ها در بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از مدل کاسپ

محل انتشار:

فصلنامه پژوهشنامه اقتصادی، دوره 12، شماره 46 (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 26

نویسندگان:

شاپور محمدی - استاد یار دانشکده مدیریت دانشگاه تهران

حامد طبسی - دانشجوی دکترای مدیریت مالی دانشگاه تهران

خلاصه مقاله:

سقوط بازار سهام هم برای سرمایه گذاران و هم برای دانشگاهیان از اهمیت ویژه‌ای برخوردار است. از آنجا که مدل های کاتاستروف، قدرت بالایی در توضیح فرآیندهای ناپیوسته دارند، در این مقاله با استفاده از مدل تصادفی کاسپ کاتاستروف، به بررسی سقوط شاخص بورس اوراق بهادار تهران می پردازیم. با استفاده از متغیرهای رشد سالیانه نقدینگی و حجم عددی معاملات، به عنوان متغیرهای کنترل، مدل تصادفی کاسپ سقوط شاخص بورس اوراق بهادار تهران را در سال های ۱۳۸۳ و ۱۳۸۷، به طور قابل ملاحظه ای بسیار بهتر از مدل غیرخطی لوجستیک نشان می دهد. این نتایج حتی پس از روندزدایی شاخص نیز بهبود یافته است.

کلمات کلیدی:

سقوط بازار سهام، نظریه کاتاستروف، مدل تصادفی کاسپ کاتاستروف، تغییرات ناگهانی، توزیع های دومی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1410181>

