

بحران بدهی و نوسان بازار سهام

تالیف:

سارا احمدی صنایع

کارشناسی ارشد حسابداری



انتشارات موجک



سرشناسه: احمدی صنایع، سارا، ۱۳۶۵-

عنوان و نام پدیدآور: بحران بدهی و نوسان بازار سهام / تألیف سارا احمدی صنایع.
مشخصات نشر: تهران: انتشارات موجک، ۱۴۰۰.

مشخصات ظاهری: ۱۰۱ ص.

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۹۹۴-۳۷۸-۴

وضعیت فهرست نویسی: فیبا

یادداشت: کتابنامه: ص. ۹۳-۱۰۱.

موضوع: بحران مالی -- ایران -- نمونه پژوهی

موضوع: Financial crises -- Iran -- Case studies

موضوع: بورس -- ایران -- نمونه پژوهی

موضوع: Stock exchanges -- Iran -- Case studies

موضوع: نوسان‌های اقتصادی -- ایران -- نمونه پژوهی

موضوع: Business cycles -- Iran -- Case studies

رده بندی کنگره: HB ۳۸۰۹/۲

رده بندی دیویی: ۳۳۸/۵۴۲۰۹۵۵

شماره کتابشناسی ملی: ۸۵۰۶۷۶۹

انتشارات موجک

واتساپ: ۰۹۳۶۳۰۳۱۲۵۸ کانال: telegram.me/mojak1

تلفن مرکز پخش: ۰۲۶۳۲۷۰۵۳۱۸ - ۰۲۶۳۲۷۲۱۸۱۹ - ۰۲۱۶۶۱۲۷۵۹۳ - ۰۲۶۶۴۲۹۷۳۳

ایمیل: mojakpublication@yahoo.com

سایت: www.mojak.ir

عنوان: بحران بدهی و نوسان بازار سهام

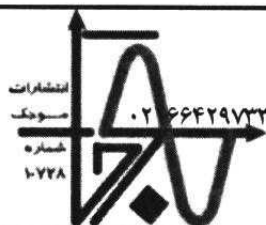
تألیف: سارا احمدی صنایع

مشخصات ظاهری: ۱۰۱ صفحه، قطع وزیری

چاپ اول: پاییز ۱۴۰۰، تیراژ: ۵۰۰ جلد

قیمت: ۴۷۰۰۰۰ ریال، شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۹۹۴-۳۷۸-۴

کلیه حقوق مادی و معنوی این اثر برای انتشارات موجک محفوظ است. هیچ شخص حقیقی و حقوقی حق چاپ و تکثیر این اثر را به هر شکل و صورت اعم از فتوکپی، چاپ کتاب و ... را ندارد. متخلفین به موجب بند ۵ ماده قانون حمایت از ناشرین تحت پیگرد قانونی قرار می‌گیرند.



فهرست مطالب

صفحه

عنوان

۱ پیش گفتار..... ۱

۳ فصل اول: کلیات..... ۳

۳ ۱-۱ تشریح موضوع کتاب..... ۳

۶ ۲-۱ اهداف..... ۶

۷ ۳-۱ تعریف سیاست پولی..... ۷

۷ ۴-۱ تعریف بحران بدهی..... ۷

۷ ۵-۱ تعریف نوسان بازار سهام..... ۷

۹ فصل دوم: بحران بدهی..... ۹

۹ ۱-۲ مقدمه..... ۹

۱۰ ۲-۲ علل به وجود آمدن بحران مالی اخیر در اقتصاد آمریکا..... ۱۰

۱۳ ۳-۲ حجم کل بدهی ها عامل هشدار دهنده وقوع بحران مالی..... ۱۳

۱۵ ۴-۲ اثر بحران مالی بر اقتصاد ایران..... ۱۵

۱۶ ۵-۲ تأثیر بحران بر سیستم بانکی..... ۱۶

۱۷ ۶-۲ تأثیر بحران بر بازار سرمایه ایران..... ۱۷

۱۸ ۷-۲ منابع پایه پولی..... ۱۸

۲۰ ۸-۲ تأثیر بدهی دولت به بانک مرکزی بر رشد پول..... ۲۰

۲۰ ۹-۲ اثر بدهی بانک ها به بانک مرکزی بر حجم پول..... ۲۰

فصل سوم: نوسان بازار سهام.....	۲۳
۱-۳ نوسانات بازار سهام.....	۲۳
۲-۳ مبانی نظری مدل سازی نوسانات بازار سهام.....	۲۵
۳-۳ اثر اهرمی.....	۲۸
۴-۳ حد نوسان قیمت سهام.....	۲۹
۵-۳ بررسی ارتباط بین نوسان بازار سهام و بدهی ها.....	۳۱
۶-۳ بازارهای افزایشی و کاهششی سهام در اقتصاد.....	۳۲

فصل چهارم: سیاست های پولی.....	۳۵
۱-۴ مفهوم سیاست های پولی.....	۳۵
۲-۴ ابزارهای سیاست پولی.....	۳۶
۳-۴ نسبت ذخیره قانونی.....	۳۷
۴-۴ عملیات بازار باز.....	۳۷
۵-۴ نرخ تنزیل مجدد.....	۳۸
۶-۴ معیارهای انتخاب ابزار سیاست پولی.....	۳۹
۷-۴ تأثیر سیاست پولی بر بخش واقعی اقتصاد.....	۳۹
۸-۴ تأثیر حجم پول بر بازده سهام.....	۴۱
۹-۴ بورس اوراق بهادار.....	۴۱
۱۰-۴ شاخص قیمت سهام در جهان.....	۴۲
۱۱-۴ شاخص کل بورس تهران و روش محاسبه آن.....	۴۳

فصل پنجم: تحقیقات مربوط به بحران بدهی.....	۴۵
۱-۵ پیشینه خارجی.....	۴۵
۲-۵ پیشینه داخلی.....	۴۹

۵۵	فصل ششم: مطالعه موردی.....
۵۵	۱-۶ مدل MRS-GARCH.....
۵۶	۲-۶ پردازش داده‌ها به روش VAR.....
۵۸	۳-۶ فرآیند VAR.....
۵۹	۴-۶ آزمون استاندارد علیت گرنجر.....
۶۰	۵-۶ چگونگی جمع‌آوری اطلاعات و داده‌ها.....
۶۰	۶-۶ معرفی مدل.....
۶۵	۷-۶ توصیف متغیرهای الگو.....
۶۸	۸-۶ پردازش فرضیه‌ها.....
۷۰	۹-۶ روش برآورد الگو.....

۷۳	فصل هفتم: یافته‌ها.....
۷۳	۱-۷ ارائه نتایج حاصل از تخمین مدل MRS-GARCH.....
۷۴	۲-۷ نتایج مربوط به بازده سهام در رژیم اول.....
۷۶	۳-۷ بررسی بازده سهام در رژیم دوم.....
۷۸	۴-۷ نتایج مربوط به واریانس شرطی محاسبه شده برای هر سال در هر دو رژیم.....
۸۱	۵-۷ ارائه نتایج مربوط به تخمین مدل VAR.....
۸۳	۶-۷ ارائه نتایج مربوط به مانایی.....
۸۴	۷-۷ نتایج تعیین وقفه بهینه.....
۸۵	۸-۷ تحلیل علیت گرنجری.....

۸۹	فصل هشتم: جمع‌بندی.....
۸۹	۱-۸ نتیجه‌گیری.....
۹۱	۲-۸ پیشنهادها.....

منابع ۹۳

منابع فارسی ۹۳

منابع لاتین ۹۹

www.ketab.ir