

رابطه متغیرهای کلان اقتصادی با شاخص کل قیمت بورس تهران: رویکرد بیزی

تاریخ دریافت: ۹۹/۱۱/۱۴

تاریخ پذیرش: ۹۹/۱۲/۲۷

کد مقاله: ۶۵۷۴۲

سمیه ریاضی نیا^۱

چکیده

در علم آمار دو رویکرد کلی بنام‌های فراوانی و بیزی برای برآورد وجود دارد. در رویکرد بیزی علاوه بر اطلاعات نمونه تصادفی، از اطلاعات پیشین درباره پارامترها تحت عنوان توزیع پیشین نیز برای برآورد استفاده می‌شود. به عبارت دیگر در رویکرد بیزی برای استنباط از ترکیبی از اطلاعات نمونه تصادفی و اطلاعات پیشین استفاده می‌شود. لذا هدف تحقیق حاضر بررسی تاثیر شاخص بهای کالا و خدمات مصرفی، قیمت طلا، قیمت نفت، نرخ ارز بر شاخص کل قیمت بورس تهران: با استفاده از رویکرد بیزی بود. تحلیل با استفاده از داده‌های فصلی در بازه زمانی بهار ۱۳۸۸ تا زمستان ۱۳۹۸ در چارچوب بیزی با استفاده از نرم‌افزار برنامه‌نویسی R صورت گرفت. نتایج تحقیق نشان داد که قیمت نفت و شاخص بهای کالا و خدمات مصرفی تاثیر معنی‌داری بر روی شاخص کل قیمت بورس تهران دارند. همچنین بر اساس انتخاب مدل بیزی، با احتمال ۰/۶۵۶ بهترین مدل برای تبیین تغییرات شاخص کل بورس تهران شامل متغیرهای قیمت نفت، قیمت دلار و شاخص بهای کالا و خدمات مصرفی می‌باشد. همچنین با احتمال ۰/۲۴۱ همه متغیرهای مستقل توانستند تغییرات شاخص کل بورس تهران را تبیین کنند.

واژگان کلیدی: شاخص کل قیمت بورس تهران، متغیرهای کلان اقتصادی، رویکرد بیزی.