



## فرم ب

### فرم اطلاعات پایان نامه های کارشناسی ارشد و دکتری

#### حرفه ای

نام واحد دانشگاهی: دانشگاه آزاد اسلامی واحد دهقان	کد واحد:	کد شناسایی پایان نامه:
نام و نام خانوادگی دانشجو: احمد علمداری شماره دانشجویی: 900735390	سال و نیمسال اخذ پایان نامه: 91 نیمسال دوم	
عنوان پایان نامه کارشناسی ارشد یا دکتری حرفه ای بررسی ارتباط علی متغیرهای کلان اقتصادی و شاخصهای بازار سرمایه		
تاریخ دفاع از پایان نامه: تعداد واحد پایان نامه:	نمره پایان نامه دانشجو به عدد:	به حروف:
چکیده پایان نامه: (شامل خلاصه، اهداف، روشهای اجرا و نتایج بدست آمده)		
<p>هدف از این پژوهش اندازه گیری، تجزیه و تحلیل و تعیین رابطه ی بلندمدت میان شاخص بازار سرمایه با متغیرهای کلان اقتصادی، نظیر تورم، نرخ رشد حجم نقدینگی، نرخ ارز و درآمد نفتی در ایران می باشد. بدین منظور، در این پژوهش تلاش شده است تا با استفاده از روش های اقتصادسنجی به سؤالات تحقیق پاسخ داده شود. محاسبات این پژوهش با استفاده از آمارهای موجود در سری زمانی 90-1376 انجام شده است و با استفاده از روش خود توضیحی با وقفه های گسترده (<math>ARDL^1</math>) این مسئله مورد بررسی قرار گرفته است. نتایج تخمین مدل پویا نشان می دهد که رابطه بلندمدتی بین متغیرهای تحقیق وجود دارد؛ نتایج آزمون های آسیب شناسی اثبات کرد مدل مورد نظر هیچ مشکلی ندارد؛ نتایج تخمین بلندمدت نشان داد که رابطه مثبتی بین متغیرهای نرخ تورم و نرخ رشد نقدینگی و متغیر وابسته (شاخص بازده نقدی سهام) وجود دارد و همچنین رابطه منفی بین متغیرهای درآمدهای نفتی و نرخ ارز با متغیر وابسته اثبات گردید؛ نتایج مدل تصحیح خطا در مدل نشان می دهد که حرکت به سمت تعادل با سرعت متعادلی صورت می گیرد.</p> <p>واژگان کلیدی: بازار سرمایه، تورم، نرخ ارز، نقدینگی، بازده نقدی سهام</p>		

امضا استاد راهنما

امضا معاون پژوهش و

امضا مدیر گروه

فناوری

دکتر امیر هرتمنی

دکتر

دکتر ماشالله ولیخانی

ماشالله ولیخانی

<sup>1</sup>. Auto Regressive Distributed Lag