

## عنوان مقاله:

آزمون هم گرایی شاخص قیمت بورس در بازارهای سهام: شواهدی از کشورهای OECD

## محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های اقتصادی ایران، دوره 23، شماره 77 (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 26

## نویسندگان:

بهناز نانوی سابق - کارشناس ارشد علوم اقتصادی، دانشگاه کردستان

علی فقه مجیدی - استادیار، گروه اقتصاد و پژوهشگر پژوهشکده کردستان شناسی، دانشگاه کردستان

احمد محمدی - استادیار، گروه اقتصاد، دانشگاه کردستان

## خلاصه مقاله:

بورس یکی از مهم ترین زیرساخت های توسعه اقتصادی در کشورهای در حال توسعه و توسعه یافته است، هم گرایی بازده بازارهای سهام نیز نشان دهنده وابستگی متقابل اقتصاد کشورها و تحرک سرمایه بین آنهاست. هدف این پژوهش، آزمون فرضیه هم گرایی شاخص قیمت بازارهای سهام در گروه کشورهای سازمان همکاری و توسعه اقتصادی [1] در دوره 2007-2017 با استفاده از رویکرد تحلیل خوشه ای فیلیپس و سول [2] (2007)، است. نتایج حاصل از پژوهش بیان کننده این است که بازارهای سهام مورد بررسی در یک خوشه هم گرا قرار نمی گیرند، اما بین بازارهای سهام سه خوشه هم گرا وجود دارد و بازار سهام لوکزامبورگ در هیچ خوشه ای قرار نمی گیرد و یک گروه غیرهم گرا را تشکیل می دهد. همچنین نتیجه آزمون هم گرایی بین خوشه ها بیان کننده این است که خوشه های اول و دوم یک خوشه هم گرا را تشکیل می دهند. [1]- Organization for Economic Co-operation and Development (OECD) [2]- Phillips and Sul

## کلمات کلیدی:

هم گرایی، بازارهای سهام، رویکرد خوشه ای، OECD

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1016671>

