

عنوان مقاله:

شناسایی ضرایب تاثیرپذیری بلندمدت بازارهای مالی بر یکدیگر با رویکرد ARDL

محل انتشار:

پنجمین کنفرانس ملی اقتصاد، مدیریت و حسابداری (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

نویسندگان:

پیمان یازوکی - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت کسب و کار (گرایش مالی) دانشگاه آزاد اسلامی واحد پرند

مسعود سیم خواه - استادیار، گروه مدیریت دانشکده علوم انسانی دانشگاه آزاد اسلامی واحد پرند

علی جمالی - مربی گروه مدیریت دانشکده علوم انسانی دانشگاه آزاد اسلامی واحد پرند

خلاصه مقاله:

با توجه به اینکه بازارهای مالی با یکدیگر مرتبط هستند، اطلاعات ایجاد شده در یک بازار، می تواند سایر بازارها را متاثر سازد. هدف از این مطالعه شناسایی ضرایب تاثیرپذیری بلندمدت مالی بر یکدیگر می باشد. متغیرهای مورد استفاده در این تحقیق شامل قیمت نفت خام، قیمت جهان طلا، نرخ ارز و شاخص بورس اوراق بهادار تهران بوده است. بدین منظور از اطلاعات روزانه دوره زمانی ۲۰۲۰-۲۰۰۹ متغیرهای تحقیق و با بکارگیری روش خود همبسته با وقفه های توزیعی ARDL جهت شناسایی رابطه متقابل پویا میان متغیرهای تحقیق استفاده گردید. تا به کمک آن تاثیرپذیری بازارهای مالی از نوسانات قیمتی یکدیگر مشخص شود. نتایج بیانگر آن بود که شاخص کل بازار سهام رابطه مثبت و معنی داری با تمامی بازارهای دارایی های دیگر داشته است. قیمت نفت خام با تمام دارایی ها بجز شاخص کل بازار سهام دارای رابطه منفی و معنی داری است و نرخ ارز نیز تحت تاثیر مثبت داراییهای مالی دیگر قرار گرفته و رابطه منفی با قیمت نفت داشته است. قیمت طلا با تمام دارایی ها بجز قیمت نفت خام دارای رابطه مثبت و معنی داری است.

کلمات کلیدی:

قیمت نفت خام، قیمت فلزات گرانبها، نرخ ارز، شاخص بازار سهام (شاخص بورس اوراق بهادار تهران)، روش خود همبسته با وقفه های توزیعی (ARDL)

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1234796>

