

## عنوان مقاله:

تاثیر شوک های مالی دولت بر میزان تولید و سطح قیمت آسفالت در ایران ( الگوی خود رگرسیون برداری ساختاری )

## محل انتشار:

پنجمین همایش علمی پژوهشی یافته های نوین علوم مدیریت، کارآفرینی و آموزش ایران (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 11

## نویسندگان:

سعید حبیب نژاد - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت بازرگانی- مدیریت مالی، دانشکده الکترونیک دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران،

علی کاشمیری - استادیار دانشکده الکترونیک، دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران

نادر صالحی - استادیار دانشکده الکترونیک، دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران

## خلاصه مقاله:

بدون شک کارآمدی نظام مالی به عنوان زیرمجموعه ای از نظام اقتصادی یک کشور و با توجه به روابط متقابل با دیگر اجزا می تواند تاثیر بسزایی بر کارایی نظام اقتصادی داشته باشد و بازار سرمایه به عنوان زیرمجموعه ای از نظام مالی، دارای جایگاه ممتازی بوده و تاثیر متقابل مولفه های اقتصاد کلان بر روند بازار سرمایه موضوعی است که به برنامه ریزی دقیق اقتصادی و اجتناب از سیاست های غلط اقتصادی می انجامد. هدف این پژوهش پاسخگویی به این پرسش کلی که آیا شوک های مالی دولت بر میزان تولید و سطح قیمت آسفالت در ایران تاثیرگذار است، صورت گرفته است. جامعه آماری این تحقیق دربرگیرنده ی دوره ای 5 ساله از سال 1390 لغایت 1395 با استفاده از داده های فصلی برای متغیرهای اوراق قرضه، نرخ ارز، شاخص قیمت، قیمت نفت و نرخ صندوق سرمایه گذاری منتشره توسط بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران و مرکز آمار ایران و شاخص قیمتی بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از نرم افزارهای اطلاع رسانی سازمان بورس و اوراق بهادار می باشد. جهت تحلیل متغیرها، ارتباط میان شاخص کلی قیمت و تولید آسفالت و مجموعه متغیرهای مستقل با استفاده از آزمون هم انباشتگی چند متغیره جانسن مورد بررسی قرار گرفته، مضافا اینکه به منظور تایید رابطه بین متغیرها از احتمال حداکثر درست نمایی و علیت گرنجر بهره گرفته شده است و برای مقایسه نتایج روش های مختلف، مفروضات تحقیق بوسیله مدل خود رگرسیون وقفه توزیعی یا ARDL و همچنین روش ساده خطی تخمین زده شده است. یافته ها دلالت بر آن دارد که بیشترین ارتباط و بهترین رابطه بین نرخ ارز و شاخص قیمتی وجود داشته و ارتباط بین این شاخص قیمتی با وقفه پیشین خود نیز تایید می گردد و از سوی دیگر ارتباطی بین نرخ صندوق سرمایه گذاری با متغیر وابسته نشان داده نشد.

## کلمات کلیدی:

اوراق قرضه، نرخ ارز، شاخص قیمت، قیمت نفت، نرخ صندوق سرمایه گذاری

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/726384>

