

## عنوان مقاله:

تحلیل تاثیر بلند مدت به روش NARDL جهش نرخ ارز سال 1397 بر شاخص صنعت خودرو

## محل انتشار:

نخستین همایش ملی رویکرد های نوین مدیریت در مطالعات میان رشته ای (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

## نویسندگان:

علیرضا سعادت - استادیار گروه حسابداری، دانشکده علوم انسانی واحد تهران غرب دانشگاه آزاد اسلامی تهران ایران

زهرا هنرمندی - گروه حسابداری، دانشکده علوم انسانی واحد تهران غرب دانشگاه آزاد اسلامی تهران ایران

سمیرا زارعی - گروه حسابداری، دانشکده علوم انسانی واحد تهران غرب دانشگاه آزاد اسلامی تهران ایران

## خلاصه مقاله:

هدف این تحقیق بررسی تأثیر بلندمدت جهش قیمت ارز سال 1397 بر قیمت سهام شرکت های خودروسازی در بورس اوراق بهادار تهران بوده است. قلمرو مکانی در این تحقیق کشور ایران بوده و به طور خاص داده های مربوط اطلاعات شاخص قیمت صنعت خودرو و همچنین متغیر نرخ ارز را شامل می شود. قلمرو زمانی این تحقیق مشتمل بر داده های روزانه بوده و طی بازه ی شناسایی شده قبل و بعد از جهش ارز بوده است. در این تحقیق، جهش قیمت ارز متغیر مستقل و شاخص سهام متغیر وابسته در نظر گرفته شد. با عنایت به هدف اصلی این تحقیق باید اظهار داشت که نوع روش تحقیق و روش توصیف و تجزیه و تحلیل اطلاعات در مطالعه حاضر روش تحلیل همبستگی بوده زیرا در این نوع تحقیقات رابطه میان متغیرهای مستقل و وابسته براساس هدف پژوهش و به کمک رهیافت رگرسیونی و بر پایه ی الگوی خود توضیح با وقفه های گسترش غیر خطی NARDL تحلیل شد. این روش تحقیق که مبتنی بر روش های تحلیل آماری و کمی است، با استفاده از داده های سری زمانی متغیرهای تحقیق درصدد الگوسازی و تبیین روابط میان متغیرهای تحقیق می باشد. در این مطالعه جهت انجام الگوسازی های تحقیق از نرم افزارهای Excel و Eviews استفاده شد. نتایج پژوهش نشان می دهد که در بازه زمانی بلندمدت بین شاخص صنعت خودرو بورس قبل از جهش قیمت ارز در سال 1397 و بعد از آن تفاوت معناداری وجود دارد.

## کلمات کلیدی:

جهش نرخ ارز، شاخص سهام، صنعت خودرو، الگوی خودتوضیح با وقفه های گسترش یافته غیر خطی NARDL

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1149696>

