

عنوان مقاله:

شناسایی متغیرهای موثر بر قیمت رمزارز بیت کوین: رویکرد میانگین گیری بیزین (BMA) و حداقل مربعات متوسط وزنی (WALS)

محل انتشار:

مهندسی مالی و مدیریت اوراق بهادار، دوره 12، شماره 46 (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 23

نویسندگان:

محمدکاظم صادقیان - گروه اقتصاد، واحد ابرکوه، دانشگاه آزاد اسلامی، یزد، ایران

کاظم یآوری - گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد، مدیریت و حسابداری، دانشگاه یزد، یزد، ایران

عباس علوی راد - گروه اقتصاد، واحد ابرکوه، دانشگاه آزاد اسلامی، یزد، ایران

خلاصه مقاله:

هدف مقاله حاضر شناسایی متغیرهای موثر بر قیمت رمزارز بیت کوین طی دوره زمانی ۲۰۱۵ تا ۲۰۱۹ و با دو روش میانگین گیری بیزین و حداقل مربعات متوسط وزنی می باشد. نتایج این تحقیق نشان می دهد متغیر قیمت رمزارزها با ساز و کار خلق متفاوت از بیت کوین و همچنین متغیر تعداد رمزارزهای در گردش با ساز و کار مشابه بیت کوین و حجم نقدینگی دلار آمریکا بر قیمت بیت کوین موثر می باشند. از سوی دیگر در خصوص اثر جفت ارزهای بازار فارکس بر قیمت بیت کوین می توان گفت، جفت ارزهایی از جمله دلار به دلار کانادا، دلار به دلار استرالیا و دلار به دلار نیوزیلند که ارزش کمتری نسبت به سایر جفت ارزهای اصلی دارند بر قیمت بیت کوین موثرند. از طرف دیگر متغیرهای تعداد رمزارز بیت کوین، تعداد رمزارزهای در گردش با ساز و کار متفاوت از بیت کوین، قیمت جهانی طلا و تعداد جستجوی کلمه بیت کوین در گوگل بر قیمت آن دارای ضرایب معناداری پایینی می باشد. در مجموع نتایج دو روش میانگین گیری بیزین و حداقل مربعات متوسط وزنی تا حدود زیادی با یکدیگر یکسان بوده و استفاده از روش انتخاب الگوی بهینه نیز این موضوع را تأیید می نماید.

کلمات کلیدی:

بیت کوین، رمزارز، میانگین گیری مدل بیزین (BMA)، حداقل مربعات متوسط وزنی (WALS)

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1205871>

