

عنوان مقاله:

ارتباط بین بازارهای جهانی نفت، طلا و گسترش ویروس کووید-۱۹: رهیافت توابع کاپولا

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی آزمایشگاه مدیریت و رویکردهای نوآورانه در مدیریت و اقتصاد (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسنده:

زینب لطیفی - عضو هیئت علمی، دانشکده مهندسی، گروه مهندسی مکانیک، دانشگاه شهید چمران اهواز - پردیس صنعتی شهدای
هویزه، سوسنگرد، ایران

خلاصه مقاله:

ویروس کووید-۱۹ با ایجاد ترس و ناامنی بر اقتصاد جهان تاثیر گذاشته و موجب نوسانات شدید بازارهای مالی گردیده است. بررسی رابطه و وابستگی بین بازارهای مالی و گسترش این بیماری یکی از موضوعات مهم می باشد و بنابراین، با توجه به اهمیت این موضوع، در این مطالعه سعی بر آن است که به تجزیه و تحلیل رابطه و وابستگی بین بازارهای جهانی نفت، طلا و گسترش کووید-۱۹ پرداخته شود. برای این منظور با استفاده از روش توابع کاپولا، داده های روزانه دوره زمانی بین فوریه ۲۰۲۰ تا سپتامبر ۲۰۲۱ مورد بررسی و آنالیز قرار گرفتند. توابع مختلف کاپولا برای بررسی رابطه بین بازار جهانی نفت و گسترش کووید-۱۹؛ و همچنین بررسی رابطه بین بازار جهانی طلا و گسترش کووید-۱۹ برآزش داده شده و بهترین مدلها بر اساس مینیمم مقادیر از معیارهای RMSE و AIC انتخاب شدند. بر اساس نتایج این مطالعه، برای شناسایی وابستگی بین بازار جهانی نفت و گسترش بیماری کووید-۱۹، بر اساس کمترین مقادیر معیارهای $RMSE=0.107$ و $AIC=0.209$ ، بهترین تابع برآزش شده، کاپولای t-استیودنت معرفی گردید که بیان کننده یک ارتباط متقارن و هم جهت بین بازدهی نفت و گسترش کووید-۱۹ می باشد، لذا، با افزایش بیماری کووید-۱۹، سرایت بیشتر شده و وابستگی تقویت میشود. از سوی دیگر، برای بیان وابستگی بین بازدهی طلا و گسترش بیماری کووید-۱۹ نیز تابع کاپولای t-استیودنت با داشتن مینیمم مقدار معیارهای $RMSE=0.022$ و $AIC=0.108$ ، بهترین تابع انتخاب گردید که نشان میدهد بین بازدهی طلا و گسترش بیماری کووید-۱۹، وابستگی متقارن و هم سو وجود دارد و با نوسان شدید کرونا، قیمت طلا نیز نوسان شدید خواهد داشت.

کلمات کلیدی:

کووید-۱۹، تابع کاپولا، بازار جهانی نفت، بازار جهانی طلا

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1347824>

