

عنوان مقاله:

سرایت تلاطم بین بازارهای مالی کشورهای منتخب اسلامی صادرکننده نفت: الگوی تلاطم تصادفی عاملی چند متغیره

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های اقتصادی ایران، دوره 26، شماره 89 (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 25

نویسندگان:

عباس شاکری - استاد، گروه اقتصاد نظری، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

تیمور محمدی - استاد، گروه اقتصاد نظری، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

زینت ذاکری - دانشجوی دکتری علوم اقتصادی، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

با گسترش فرآیند جهانی شدن، ارتباط بین بازارهای مالی کشورها بیشتر و باعث شده سرمایه گذاران جهت کسب سود بیشتر بین بازارهای مالی کشورهای مختلف حرکت کنند. با توجه به شرایط ایران و مواجهه به مساله تحریم، امکان سرمایه گذاری در بازارهای مالی شناخته شده با ریسک تحریم روبه رو است. در این مقاله، مساله اساسی وجود و بررسی چگونگی سرایت تلاطم بین بازارهای مالی ایران و کشورهای اسلامی صادرکننده نفت است. از این رو، از یک الگوی تلاطم تصادفی عاملی چندمتغیره و داده های شاخص قیمت سهام در بازارهای مالی کشورهای منتخب با تواتر روزانه طی دوره زمانی ۵/۱۲/۲۰۰۸ تا ۱۹/۰۲/۲۰۲۰ استفاده شده است. نتایج نشان می دهد فرضیه اصلی مقاله مبنی بر سرایت تلاطم بین بازارهای مالی کشورهای اسلامی صادرکننده نفت عضو اوپک از روند تصادفی مشترک و یکسانی تبعیت می کند؛ برای کشورهای امارات متحده عربی، عربستان و قطر صدق کرده، اما برای کشورهای ایران و نیجریه صادق نیست. بنابراین، متنوع سازی سبد دارایی بین بازارها در بلندمدت برای سرمایه گذاران ایرانی در بازارهای مالی کشورهای اسلامی عضو اوپک می تواند ریسک سرمایه گذاری را کاهش دهد و با توجه به شرایط تحریم، این اقتصادها می توانند مقصد سرمایه گذاری برای ایرانیان باشند.

کلمات کلیدی:

سرایت تلاطم، الگوی تلاطم تصادفی عاملی، کشورهای اسلامی صادرکننده نفت

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1472842>

