

## عنوان مقاله:

شناسایی تاثیر اندرکنش پویا بازارهای مالی بر بازار جهانی طلا و بازار سهام ایران

## محل انتشار:

فصلنامه پژوهش در حسابداری و علوم اقتصادی، دوره 4، شماره 3 (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

## نویسندگان:

پیمان یازوکی - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت کسب و کار (گرایش مالی) دانشگاه آزاد اسلامی واحد پرند

مسعود سیم خواه - استادیار، گروه مدیریت دانشکده علوم انسانی دانشگاه آزاد اسلامی واحد پرند

علی جمالی - استادیار، گروه مدیریت دانشکده علوم انسانی دانشگاه آزاد اسلامی واحد پرند

## خلاصه مقاله:

نوسانات در بازار دارایی های مختلف به شدت به یکدیگر مرتبط بوده و به منظور اتخاذ تصمیمات مناسب توسط سرمایه گذاران، آگاهی از روابط بین دارایی های مالی امری ضروری می نماید. هدف این مطالعه شناسایی تاثیر اندرکنش پویا بین بازارهای مالی بر نوسانات بازار جهانی طلا و بازار سهام ایران می باشد. متغیرهای مورد استفاده در این تحقیق شامل نرخ ارز، قیمت طلا، نفت خام و شاخص بورس اوراق بهادار تهران بوده است. بدین منظور از اطلاعات روزانه دوره زمانی ۲۰۰۹-۲۰۲۰ متغیرهای تحقیق و روش خودهمبسته با وقفه های توزیعی ARDL استفاده شد. نتایج بیانگر آن بود که شاخص کل بازار سهام رابطه مثبت و معنی داری با تمامی بازارهای دارایی های دیگر داشته است. قیمت طلا با تمام دارایی ها بجز قیمت نفت خام دارای رابطه مثبت و معنی داری است.

## کلمات کلیدی:

قیمت نفت خام، قیمت طلا، نرخ ارز، شاخص بازار سهام (شاخص بورس اوراق بهادار تهران)، روش خود همبسته با وقفه های توزیعی (ARDL)

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1497975>

