

عنوان مقاله:

اثر شاخص فعالیت واقعی اقتصادی جهانی بر شاخص سهام ایران

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد و تجارت نوین، دوره 17، شماره 3 (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 30

نویسندگان:

معصومه دادگر - دانشجوی دکترای اقتصاد، دانشکده علوم اجتماعی و اقتصادی دانشگاه الزهرا

ویدا ورهرامی - دانشیار گروه اقتصاد دانشکده اقتصاد و علوم سیاسی دانشگاه شهید بهشتی

میرحسین موسوی - دانشیار گروه اقتصاد دانشکده علوم اجتماعی و اقتصادی دانشگاه الزهرا

خلاصه مقاله:

در مواجهه با تلاطم های مکرر بازار سهام که به زیان سرمایه گذاران منجر می شود، تعیین عواملی که قادر به پیش بینی هر چه دقیق تر شاخص سهام هستند، ضروری است. این عوامل بستگی به شرایط اقتصادی، سیاسی، اجتماعی، فرهنگی و ... در هر کشوری بستگی دارد. لذا این مطالعه رابطه بین شاخص سهام ایران و فعالیت اقتصادی جهانی را بررسی می کند. از این رو، شاخص اقتصادی کیلیان به عنوان شاخصی برای برآورد فعالیت اقتصادی جهانی استفاده می شود. پس از تعریف و شیوه محاسبه این شاخص، در ادامه این مقاله به بررسی اثر شوک های وارد بر فعالیت واقعی اقتصادی بر شاخص سهام ایران می پردازد. لذا با به کارگیری روش برآورد خودرگرسیون برداری ساختاری (SVAR) طی دوره زمانی ۱۳۸۷:۰۱ تا ۱۳۹۸:۰۳ و استفاده از توابع واکنش آنی و تجزیه واریانس به بررسی اثر متغیر فعالیت اقتصاد جهانی بر شاخص سهام ایران پرداخته شده است. همچنین از متغیرهای قیمت نفت، تولید جهانی نفت و نرخ ارز به عنوان متغیرهای کمکی و موثر بر شاخص سهام استفاده شده است. نتایج توابع واکنش آنی نشان می دهد که در کوتاه مدت، شوک های فعالیت واقعی اقتصادی جهانی مشخصا از ابتدای دوره تا انتهای دوره اثر مثبت بر شاخص سهام داشته است و به عبارتی شاخص سهام واکنش مثبت به شوک این متغیر نشان داده است.

کلمات کلیدی:

شاخص کیلیان؛ فعالیت واقعی اقتصادی جهانی؛ شاخص سهام؛ SVAR؛ قیمت نفت طبقه بندی JEL: N۲, G۱۰, F۶۵, F۰۰

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1602863>

