

عنوان مقاله:

بررسی رابطه ی بین متغیرهای اقتصاد کلان و شاخص قیمت سهام در ایران (رویکرد الگوی تصحیح خطای برداری)

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد مقداری، دوره 8، شماره 3 (سال: 1390)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

نویسندگان:

زهرا نصراللهی - استادیار اقتصاد دانشگاه یزد

خدیجه نصراللهی - استادیار اقتصاد دانشگاه اصفهان

سید مرتضی میرزابابایی - کارشناس ارشد حسابداری

خلاصه مقاله:

در این تحقیق به تجزیه و تحلیل تاثیر برخی از متغیرهای اقتصادی مانند: CPI، نرخ ارز، شاخص قیمت مسکن، شاخص قیمت طلا و ارزش افزوده بخش صنعت، بر شاخص بورس اوراق بهادار با استفاده از الگوی بردارهای خود رگرسیونی (VAR) و مدل تصحیح خطای برداری (VECM) در دوره ی زمانی ۸۵-۱۳۷۰ (با استفاده از داده های فصلی) پرداخته شده است. بر اساس نتایج این تحقیق در کوتاه مدت شاخص قیمت سهام تحت تاثیر مقدار شاخص قیمت سهام در دوره های قبل، نرخ ارز و ارزش افزوده ی بخش صنعت قرار داشته است. اما در بلندمدت شاخص قیمت سهام تحت تاثیر شاخص قیمت طلا، شاخص قیمت مسکن، شاخص قیمت کالاها و خدمات مصرفی، نرخ ارز، ارزش افزوده ی بخش صنعت و صادرات قرار دارد. طبقه بندی B۲۲، E۴۴، G۱۵، G۱۰ JEL:

کلمات کلیدی:

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1821082>

