

## عنوان مقاله:

طراحی مدلی برای سنجش پویایی ارتباطات تلاطمات بورس اوراق بهادار تهران و بازارهای جهانی

## محل انتشار:

فصلنامه مدل سازی اقتصادی، دوره 14، شماره 49 (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 24

## نویسندگان:

ناصر غلامی - دانشجوی دکتری اقتصاد نفت و گاز، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

تیمور محمدی - دانشیار گروه اقتصاد انرژی، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

عبدالرسول قاسمی - دانشیار گروه اقتصاد نظری، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

## خلاصه مقاله:

هدف این مقاله اندازه گیری پویایی ارتباطات بازار تهران با بورس های اوراق بهادار کشورهای منتخب خاورمیانه و چین، بازارهای نفت و طلا، شاخص دلار و جفت ارزهای یورو- دلار و یوان- دلار است. بدین منظور، از رویکرد تجزیه واریانس برای اندازه گیری ارتباطات تلاطمات طی دوره ۲۰۰۸ - ۲۰۱۹ استفاده شده است. یافته ها نشان داد واریانس خطای پیش بینی تر بازارها ناشی از شوک های خود آن بازارها بوده است. بورس اوراق بهادار تهران ارتباطات بسیار کمی با سایر بازارها دارد. با افزایش افق زمانی، تاثیرپذیری بازارها از یکدیگر افزایش می یابد. بازار نفت برنت بیش تر از بورس های کشورهای عربی و شانگهای کامپوزیت تاثیر می پذیرد. بر اساس نتایج، سرمایه گذاری در بورس اوراق بهادار تهران و برابری یوان- دلار به دلیل پویایی ارتباطات کم با سایر بازارها به منظور پوشش ریسک پیشنهاد می شود.

## کلمات کلیدی:

طبقه بندی JEL: G15؛ D53؛ D58. واژگان کلیدی: بورس اوراق بهادار تهران، پویایی ارتباطات، بازارهای مالی، تجزیه واریانس

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1860012>

