

عنوان مقاله:

اثر شکستهای ساختاری در نوسانات بر انتقال تکانه و سرریز نوسان میان بازارهای طلا و سهام ایران

محل انتشار:

فصلنامه مدلسازی اقتصادی، دوره 8، شماره 26 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

زهرا (میلا) علمی - دانشیار دانشگاه مازندران

اسمعیل ابونوری - استاد دانشگاه سمنان

سعید راسخی - دانشیار دانشگاه مازندران

محمد مهدی شهرازی - دانشجوی دکتری مازندران

خلاصه مقاله:

این مطالعه اثر تغییرات ساختاری در نوسانات بر انتقال تکانه و سرریز نوسان میان دو بازار طلا و سهام ایران را طی دوره‌ی زمانی ۱۳۹۲/۰۵/۲۵-۱۳۸۶/۰۱/۰۵ بررسی میکند. برای این منظور، ابتدا زمان‌هایی که تغییرات ساختاری در نوسانات رخ داده است با استفاده از الگوریتم متعارف مجموع مربعات تجمعی تکراری و هم‌چنین، الگوریتم اصلاح‌شده‌ی مجموع مربعات تجمعی تکراری به طور درون‌زا شناسایی شده و سپس این اطلاعات وارد فرآیند مدل‌سازی نوسانات میگردد. نتایج حاصل از کاربرد روش ناهمسانی واریانس شرطی تعمیم‌یافته‌ی دو متغیره در قالب تصریح غیر قطری بابا، انگل، کرافت و کرونر [۱] نشان میدهد که انتقال تکانه‌ها و سرریز نوسانات میان بازارهای طلا و سهام ایران به صورت دو طرفه میباشد. هم‌چنین، بر اساس یافته‌ها، نادیده گرفتن و یا تعیین نادرست تغییرات ساختاری در نوسانات، محقق را در ارزیابی جهت سرایت تکانه و سرریز نوسان میان بازارهای طلا و سهام گمراه می‌سازد. [۱] Baba, Engle, Kraft and Kroner

کلمات کلیدی:

تغییرات ساختاری، نوسانات، انتقال تکانه، اثر سرریز، الگوریتم مجموع مربعات تجمعی تکراری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1872950>

