

عنوان مقاله:

بررسی اثرات متقابل گواهی سپرده کالایی و آتی زعفران در بورس کالای ایران

محل انتشار:

مجله تحقیقات اقتصاد کشاورزی، دوره 14، شماره 4 (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

سید میثم جلیلی - دانشجوی دکتری اقتصاد، دانشکده مدیریت و حسابداری، واحد قزوین، دانشگاه آزاد اسلامی، قزوین، ایران.

اکبر میرزاپوربابا جان - استادیار اقتصاد، دانشکده مدیریت و حسابداری، واحد قزوین، دانشگاه آزاد اسلامی، قزوین، ایران.

بیت اله اکبری مقدم - استادیار اقتصاد، دانشکده مدیریت و حسابداری، واحد قزوین، دانشگاه آزاد اسلامی، قزوین، ایران.

آرش هادی زاده میارکلائی - استادیار اقتصاد، دانشکده مدیریت و حسابداری، واحد قزوین، دانشگاه آزاد اسلامی، قزوین، ایران.

خلاصه مقاله:

مقدمه و هدف: با معرفی گواهی سپرده کالایی در بورس کالای ایران، این پژوهش با عنایت به فقدان مطالعه در حوزه گواهی سپرده زعفران، سعی در شناخت عوامل موثر بر آن و از جمله تاثیر قیمت آتی زعفران با استفاده از بررسی وجود رابطه علیت خطی و غیر خطی در راستای شناخت مکانیسم کشف قیمت در بازار زعفران می‌کند. مواد و روش‌ها: داده‌های روزانه در بازه زمانی خرداد ماه ۱۳۹۷ تا پایان تیرماه ۱۳۹۸ اخذ شده و از نوسانات قیمتی گواهی سپرده کالایی و قیمت آتی ها استفاده شده است. روش پژوهش توصیفی-تحلیلی و روش گردآوری داده‌ها کتابخانه ای با استفاده از روشهای اقتصاد سنجی، مدل های رگرسیونی و مفهوم شبکه های عصبی به کمک نرم افزارهای R و EViews صورت گرفته است. یافته‌ها: نتایج نشان می‌دهد که رابطه علیت خطی بین نوسانات قیمت گواهی سپرده و قیمت آتی وجود دارد و این رابطه دوطرفه است. برای بررسی وجود علیت غیرخطی با استفاده از پسماند بدست آمده مدل VAR بین دو متغیر مورد بررسی و استفاده از آزمون BDS وجود یک رابطه غیر خطی بین متغیرها اثبات شد. بحث و نتیجه‌گیری: با توجه به جهت علیت قیمت‌ها از آتی‌ها به بازار نقد، نتایج این پژوهش نشان می‌دهد که بازار آتی نقشی تعیین کننده در قیمت بازار نقد دارد و بنابراین، کشف قیمت در بازار آتی‌ها شکل می‌گیرد و بازار گواهی سپرده از بازار آتی تبعیت می‌کند.

کلمات کلیدی:

گواهی سپرده کالایی، آتی‌ها، نوسانات قیمت، شبکه عصبی، علیت گرنجر غیرخطی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1905974>

