

## عنوان مقاله:

بررسی رابطه بین نقدینگی و شاخص قیمت بورس اوراق بهادار

## محل انتشار:

کنفرانس ملی رویکردهای نوین در علوم مدیریت ، اقتصاد و حسابداری (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

## نویسندگان:

محجوبه تقی زاده فیروزجایی - دانشگاه آزاد اسلامی بابل

فاطمه تاجیک نژاد - دانشگاه آزاد اسلامی بابل

عباسعلی پورآقاجان سرمامی - دانشگاه آزاد اسلامی واحد قائمشهر

مائده تیموری - دانشگاه آزاد اسلامی بابل

## خلاصه مقاله:

شاخص کل بورس در هر کشور، مهمترین ابزار بررسی وضعیت بورس اوراق بهادار آن کشور است. هدف اصلی این پژوهش، بررسی رابطه بین متغیر نقدینگی و شاخص قیمت بورس اوراق بهادار می باشد. بنابراین با استفاده از داده های فصلی بین سال های 1380-1391 و توسط الگوی خودرگرسیون برداری VAR و آزمون علیت گرنجر وجود ارتباط بین این متغیرها مورد آزمون قرار گرفت. نتایج حاکی از این بود که رابطه بین این دو متغیر یک سویه و از سمت متغیر نقدینگی بر شاخص قیمت بورس اوراق بهادار می باشد. در نهایت با استفاده از تجزیه واریانس خطای پیش بینی مشخص گردید اثر شاخص قیمت بورس بر نقدینگی در بلندمدت بسیار ناچیز است اما اثر رشد نقدینگی بر شاخص قیمت بورس تا دوره ششم افزایش می یابد و این اثر مثبت خواهد بود و پس از این رون مثبت حالت با ثباتی به خود می گیرد.

## کلمات کلیدی:

الگوی خودرگرسیون برداری، شاخص بورس اوراق بهادار، علیت گرنجر، نقدینگی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/370688>

