

عنوان مقاله:

تأثیر قیمت نفت، نرخ دلار، شاخص صنعت و شاخص کل بر تحلیل قیمت طلا در ایران به روش درخت تصمیم گیری

محل انتشار:

کنگره بین المللی توانمندسازی جامعه در حوزه مدیریت، اقتصاد، کارآفرینی و مهندسی فرهنگی (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسندگان:

فاطمه طایفی نصرآبادی - دانشجوی کارشناسی ارشد مهندسی مالی دانشگاه علم و هنر یزد

محمدحسین عبدالرحیمیان - عضو هیأت علمی دانشگاه آیت الله حائری میبد

خلاصه مقاله:

طلا همواره به عنوان یک دارایی سرمایه ای از اهمیت بالایی برخوردار بوده است و به علت قدرت نقد شوندگی بالایی که دارد مورد توجه همگان بوده است. نوسانات قیمت طلا اثرات روشنی بر روی وقایع مالی و اقتصادی هر کشوری دارد و در حال حاضر طلا به عنوان یک بازار بزرگ اقتصادی در کنار بازارهای سرمایه دیگر پیش روی سرمایه گذاران قرار دارد و نوسانات قیمت آن بیش از پیش در متغیرهای اقتصادی، رونق و رکود سایر بازارها موثر است. با توجه به نوسانات شدیدی که این دارایی سرمایه ای در 4 سال اخیر، یعنی از سال 1391 تا 1394 داشته است، تصمیم بر این شد تا در این پژوهش به بررسی و تحلیل قیمت طلا پرداخته شود و همچنین چهار متغیر را در نظر گرفتیم و تاثیرات و رابطه آن ها را با نوسانات قیمت طلا در ایران بررسی کردیم این چهار متغیر شامل قیمت نفت، نرخ دلار، شاخص صنعت و شاخص کل بود و برای تحلیل و پردازش قیمت های شاخص های سکه طلا، گرم طلا، نرخ دلار، قیمت نفت و شاخص صنعت و کل برای 4 سال در نظر گرفتیم و با استفاده از نرم افزار برنامه نویسی R و یکی از روش های داده کاوی به نام درخت تصمیم به تجزیه و تحلیل داده ها پرداختیم و قیمت های شاخص ها را به بازده تبدیل کردیم یعنی امروز ln را دیروز ln کم کردیم و در واقع ورودی های داده هایی هستند که گسسته اند و همچنین در ادامه ی کار برای آن که کار تحلیل به راحتی انجام شود داده ها به پنج رنج تقسیم شدند که شامل موارد کم، خیلی کم، متوسط، زیاد و خیلی زیاد است به کمک این پنج رنج به راحتی توانستیم نمودارهای درختی را بررسی کنیم بعد از بررسی نمودارها و شکل ها به این نتیجه رسیدیم که در بین آن چهار متغیر تنها متغیر دلار عاملی است که به طور زیادی بر نوسانات قیمت طلا در ایران تاثیرگذار است و با این که تصور بر آن بود که متغیر نفت نیز اثرگذار باشد اما در این تحقیق قیمت نفت تاثیری بر نوسانات قیمت طلا در این 4 سال نداشت.

کلمات کلیدی:

قیمت طلا، درخت تصمیم گیری، نرخ ارز، قیمت نفت

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/566081>

