

عنوان مقاله:

تجزیه و تحلیل یکپارچگی بین توسعه بازار مالی (رشد شاخص های بورس اوراق بهادار) و رشد شاخص های اقتصادی

محل انتشار:

نخستین کنفرانس ملی تحقیق و توسعه در مدیریت و اقتصاد مقاومتی (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 17

نویسندگان:

فرهاد آهنگ - دانشجوی کارشناس ارشد مدیریت مالی دانشگاه آزاد اسلامی واحد قشم

محمدحسین رنجبر - عضو هیئت علمی دانشگاه آزاد اسلامی واحد بندرعباس

احد عامری سیاهویی - مدرس دانشگاه آزاد اسلامی واحد بندرعباس

خلاصه مقاله:

این پژوهش به صورت تجربی به تجزیه و تحلیل یکپارچگی بین توسعه بازار مالی (رشد شاخص های بورس اوراق بهادار) و رشد شاخص های اقتصادی با استفاده از داده های سری زمانی از 1384 تا 1393 به صورت ماهانه در ایران پرداخته است. متغیرهای جایگزین رشد شاخص های بورس اوراق بهادار: رشد حجم مبادلات، رشد ارزش معاملات و رشد شاخص کل بورس و متغیرهای رشد شاخص های اقتصادی: تولید ناخالص داخلی، رشد حجم سرمایه، رشد درآمد سرانه، ایجاد فرصت های شغلی می باشد. جهت بررسی رابطه علیت کوتاه مدت و بلندمدت از روش تصحیح خطای برداری استفاده شده است. نتایج آزمون علیت گرنجری بین رشد تولید ناخالص داخلی و رشد شاخص های بورس اوراق بهادار نشان می دهد که رابطه علیت یک طرفه در کوتاه مدت و بلندمدت از رشد تولید ناخالص داخلی به رشد شاخص های بورس اوراق بهادار (رشد حجم مبادلات، رشد ارزش معاملات و رشد شاخص کل بورس) وجود دارد. نتایج آزمون علیت گرنجری بین رشد حجم سرمایه و رشد شاخص های بورس اوراق بهادار نشان می دهد که در کوتاه مدت هیچ رابطه علیت بین رشد شاخص های بورس اوراق بهادار (رشد حجم مبادلات، رشد ارزش معاملات و رشد شاخص کل بورس) و رشد حجم سرمایه وجود ندارد. آزمون علیت گرنجری بلند مدت نشان می دهد که یک رابطه علیت از رشد درآمد سرانه به رشد ارزش معاملات وجود دارد. نتایج آزمون علیت گرنجری بلند مدت نشان می دهد که تنها یک رابطه علیت از رشد درآمد سرانه به رشد ارزش معاملات وجود دارد. نتایج آزمون علیت گرنجری بلند مدت نشان می دهد که تنها یک رابطه علیت از رشد درآمد سرانه به رشد ارزش معاملات وجود دارد. نتایج آزمون علیت گرنجری بین ایجاد فرصت های شغلی و رشد شاخص های بورس اوراق بهادار نشان می دهد که در کوتاه مدت هیچ رابطه علیت بین ایجاد فرصت های شغلی و رشد شاخص های بورس اوراق بهادار (رشد مبادلات، رشد ارزش معاملات، رشد شاخص کل بورس) وجود ندارد. آزمون علیت گرنجری بلند مدت نشان می دهد که یک رابطه علیت از ایجاد فرصت های شغلی به رشد حجم مبادلات و رشد ارزش معاملات وجود دارد.

کلمات کلیدی:

رشد حجم مبادلات، رشد ارزش معاملات و رشد شاخص کل بورس، رشد تولید ناخالص داخلی، رشد حجم سرمایه، رشد درآمد سرانه، ایجاد فرصت های شغلی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/787761>



