

عنوان مقاله:

بررسی اثر نااطمینانی بازار سهام بر رشد اقتصادی ایران رهیافت خودرگرسیون با وقفه های توزیعی ARDL

محل انتشار:

کنگره ملی تحقیقات بنیادین در مدیریت اقتصاد و حسابداری (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 11

نویسندگان:

احمد جعفری صمیمی - استاد گروه اقتصاد، دانشگاه مازندران

زهره محمدپور میر - کارشناسی ارشد اقتصاد، دانشگاه مازندران

سعید زنگوری - کارشناسی ارشد مدیریت بازرگانی - مالی، دانشگاه سمنان

خلاصه مقاله:

بازار سهام مکانی برای معامله دارایی های مالی و ابزاری قدرتمند در جذب پس اندازهای داخلی است. نوسانات قیمت سهام به عنوان یک عامل بی ثباتی می تواند رشد اقتصادی را تحت تاثیر قرار دهد. برهمن اساس مطالعه ی حاضر در نظر دارد، تا با استفاده از الگوی پیشنهادی لوبین و رنلت 1992 و داده های فصلی طی دوره معین (از سه ماهه سوم 1373 تا سه ماهه اول 1397) به بررسی اثرنااطمینانی بازار سهام بر رشد اقتصادی ایران بپردازد. به این ترتیب که ابتدا نوسانات قیمت سهام بوسیله الگوی گارچ نمایی EGARCH محاسبه شده و سپس اثر این نوسانات بر رشد اقتصادی ایران، با استفاده از رهیافت خود رگرسیون با وقفه های توزیعی (ARDL) برآورد می شود. یافته های حاصل از پژوهش نشان می دهد که، اثر نوسانات قیمت سهام بر رشد اقتصادی ایران منفی و معنادار است.

کلمات کلیدی:

نااطمینانی بازار سهام، رشد اقتصادی، گارچ نمایی، الگوی خودرگرسیون با وقفه های توزیعی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/949968>

