

عنوان مقاله:

بررسی عوامل مؤثر بر نوسانات قیمت سکه بهار آزادی در ایران با استفاده از مدل‌های خانواده ARCH

محل انتشار:

اولین کنفرانس اقتصاد و مدیریت کاربردی با رویکرد ملی (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

مسعود رادنیا - کارشناس ارشد علوم اقتصادی، گرایش برنامه ریزی و سیستم‌های اقتصادی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران مرکزی

فاطمه جهانگرد - کارشناس ارشد علوم اقتصادی، گرایش علوم اقتصادی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران مرکزی

سید مرتضی خانی هولاری - کارشناس ارشد علوم اقتصادی، گرایش توسعه اقتصادی و برنامه ریزی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران مرکزی

خلاصه مقاله:

طی سال‌های اخیر قیمت سکه در ایران همسو با قیمت طلا در بازارهای جهانی روندی صعودی را تجربه نموده است. وابستگی تنگاتنگ بازارهای مالی به یکدیگر لزوم بررسی ارتباط این بازارها را ضروری می‌نماید. در این مقاله با استفاده از داده‌های سری زمانی ماهانه در فاصله زمانی سال‌های 1380-1390، ضمن بررسی عوامل تاثیرگذار بر قیمت سکه بهار آزادی، الگوی رفتاری آن بوسیله مدل E-GARCH مورد ارزیابی و تحلیل قرار گرفت. نتایج نشان می‌دهند از بین عوامل موثر بر قیمت سکه بهار آزادی، نرخ ارز (نرخ برابری ریال بر دلار) بیشترین تاثیر را دارا بوده و سپس قیمت‌های اونس طلای جهانی و نفت اوپک به ترتیب تاثیر گذارترین عوامل بوده‌اند، همچنین شاخص قیمت مصرف‌کننده (CPI) کمترین تاثیر را بر قیمت سکه داشته است.

کلمات کلیدی:

قیمت سکه، اونس طلا، نرخ واقعی ارز، مدل‌های ARCH/GARCH

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/290038>

