

عنوان مقاله:

بررسی تاثیر قیمت نفت و نرخ ارز بر شاخص قیمت بازار سهام در ایران

محل انتشار:

سومین کنفرانس بین المللی ترفندهای مدرن مدیریت، حسابداری، اقتصاد و بانکداری با رویکرد رشد کسب و کارها (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

نویسندگان:

شبیم زین الدینی - کارشناسی ارشد اقتصاد نظری، دانشگاه رازی

محمدشریف کریمی - استادیار، گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد و کارآفرینی، دانشگاه رازی

آزاد خانزادی - استادیار، گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد و کارآفرینی، دانشگاه رازی

خلاصه مقاله:

با توجه به اهمیت و نقشی که نرخ ارز و قیمت نفت بر اقتصاد ایران دارند، همواره تغییر در این دو عامل وضعیت اقتصادی را تحت تاثیر قرار می دهند. بنابراین بازارهای مالی کشور از جمله بازار سهام نیز از هرگونه تغییر در این دو متغیر مهم مستثنی نیست. بازار سهام یکی از بازارهای مالی است که امکان تامین مالی و افزایش سرمایه گذاری را فراهم می کند. اصلی ترین شاخص بازار بورس، شاخص قیمت سهام می باشد. لذا این مطالعه به بررسی تاثیر نوسانات قیمت نفت و نرخ ارز بر شاخص قیمت سهام ایران می پردازد. برای این منظور از داده های فصلی از سال 1388 تا سال 1395 استفاده می شود. در این پژوهش از رویکرد خود رگرسیون برداری ساختاری SVAR استفاده می گردد. نتایج بدست آمده از تجزیه واریانس نشان داد که بیشتر تغییرات شاخص قیمت سهام، به ترتیب تحت تاثیر شاخص قیمت سهام، قیمت نفت و نرخ ارز بوده است. تجزیه و تحلیل نمودارهای حاصل از تابع واکنش آنی بیان می کند که اثر مثبت و اندک در ابتدای دوره شوک های ناشی از تحركات قیمت نفت و شوک های نرخ ارز بر روی شاخص قیمت سهام وجود دارد.

کلمات کلیدی:

قیمت نفت، نرخ ارز، بازار سهام، مدل خود رگرسیون برداری ساختاری (SVAR)

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1018875>

