

عنوان مقاله:

بررسی تاثیر بلند مدت جهش قیمت ارز سال ۱۳۹۷ بر قیمت سهام صنعت دارو در بورس اوراق بهادار تهران به روش NARDL

محل انتشار:

ششمین کنفرانس بین المللی پژوهش های نوین در مدیریت، اقتصاد، حسابداری و بانکداری (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 8

نویسندگان:

علیرضا سعادت - کارشناسی ارشد حسابداری، دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران غرب، تهران، ایران

زهرا هنرمندی - استایار گروه حسابداری، دانشکده علوم انسانی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران غرب، تهران، ایران

سمیرا زارعی - استادیار گروه حسابداری، دانشکده علوم انسانی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران غرب، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

هدف این تحقیق بررسی تاثیر بلندمدت جهش قیمت ارز سال ۱۳۹۷ بر قیمت سهام صنایع دارویی در بورس اوراق بهادار تهران بوده است. جامعه آماری تحقیق، شرکت های فعال در صنعت دارویی بورس اوراق بهادار تهران قلمرو زمانی این تحقیق مشتمل بر داده های روزانه بوده و طی بازه ی زمانی از آذر 87 تا آبان 1397 بوده است. در این تحقیق، جهش قیمت ارز متغیر مستقل و قیمت سهام شرکت های دارویمتغیر وابسته در نظر گرفته شد. نوع روش تحقیق روش تحلیل همبستگی بوده و به کمک رهیافت رگرسیونی و بر پایه ی الگوی خودتوضیح باوقفه های گسترش یافته غیرخطی (NARDL) تحلیل می گردد. این روش تحقیق که مبتنی بر روش های تحلیلی آماری و کمی است، با استفاده از داده های سری زمانی متغیرهای تحقیق در صدد الگوسازی و تبیین روابط میان متغیرهای تحقیق می باشد. نتایج پژوهش نشان می دهد که بینشاخص صنایع قبل از جهش قیمت ارز در سال ۱۳۹۷ و بعد از آن تفاوت معناداری وجود دارد. با توجه به بی سابقه بودن تغییرات نرخ ارز در سال 1397، در چهل سال اخیر، این پژوهش دارای نوآوری در مقطع زمانی بوده و هم چنین روش تحقیق نیز تا کنون در کشور با این موضوعکارگرفته نشده است.

کلمات کلیدی:

جهش نرخ ارز، صنعت دارو، روش NARDL

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1119619>

