

عنوان مقاله:

بررسی تاثیر شوک های قیمت نفت بر نوسان پذیری بازده سهام صنایع در بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

دومین کنفرانس بین المللی چالش ها و راهکارهای نوین در مهندسی صنایع و مدیریت و حسابداری (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

نویسندگان:

محمد ندیری - استادیار دانشگاه تهران، پردیس فارابی، دانشکده مدیریت و حسابداری گروه مالی

چیا حسینی - کارشناس ارشد مدیریت مالی دانشگاه تهران

خلاصه مقاله:

این پژوهش تاثیر شوکهای قیمت نفت بر نوسان بازدهی شاخص بورس و شاخص صنایع مختلف بورس اوراق بهادار تهران بر مبنای داده های روزانه در دوره زمانی سال های ۵۸۳۱ تا ۵۸۳۱ بررسی کرده است. به منظور بررسی این رابطه با استفاده از مدل GARCH تک متغیره شوک های قیمت نفت خام تخمین زده شده و با استفاده از مدل GARCH-M ارتباط بین شوک قیمت نفت و نوسان بازدهی شاخص بورس و شاخص های صنایع بورس اوراق بهادار مورد بررسی قرار گرفته است. نتایج نشان می دهد که شوک قیمت نفت خام تاثیر مستقیم و معناداری بر نوسان بازدهی شاخص کل بورس دارد، همچنین شوک قیمت نفت خام تاثیر مستقیم و معناداری بر نوسان بازدهی شاخص محصولات شیمیایی و فرآورده های نفتی دارد.

کلمات کلیدی:

شوک قیمت نفت خام، بازده شاخص کل بورس، شاخص های صنایع بورس، مدل های گارچ

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1245078>

