سیویلیکا - ناشر تخصصی مقالات کنفرانس ها و ژورنال ها
گواهی ثبت مقاله در سیویلیکا
CIVILICA.com

عنوان مقاله:
تاثیر خبر افزایش قیمت خوراک پتروشیمی بر شاخص بازار سهام تهران

محل انتشار:
فصلنامه اقتصاد مالی, دوره 9, شماره 33 (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:
سعید نایب - *استادیار دانشگاه آزاد واحد تهران مرکزی*

منیژه هادی نژاد - *استادیار دانشگاه آزاد واحد تهران مرکزی*

فرشته شمس صفا - *کارشناسی ارشد واحدتهران مرکزی*

خلاصه مقاله:
چکیده بازار سرمایه به مثابه پل ارتباطی بین «پس‌انداز کنندگان انفرادی و نهادی» و «سرمایه‌گذاران نیازمند وجوه» با انجام دو وظیفه مهم «تامین منابع مالی دراز مدت» و «مدیریت خطرپذیری (ریسک)» نقش بسزایی در افزایش ضریب اطمینان و حجم سرمایه‌گذاری‌ها، به ویژه در فعالیت‌های بلندمدت اقتصادی ایفا می‌نماید. امروزه صنعت پتروشیمی باسهم۲۱ درصدی از میانگین ارزش معامله های روزانه بورس تهران درسال ۱۳۹۲ از جایگاه ویژه‌ای در بازار سرمایه برخوردار است. این صنعت علاوه بر ارزش‌افزوده‌ای که در مقابل خام‌فروشی منابع عظیم نفتی و گازی ایجاد می‌نماید، سهم قابل توجه‌ای را در معامله های بازار بورس از طریق جمع‌آوری پس‌اندازهای خرد جامعه بر عهده داشته است. افزایش قیمت خوراک گاز پتروشیمی به دلیل ترس و نگرانی بر عملکرد این صنعت از مدت‌ها پیش مورد نقد کارشناسان و تصمیمگیران اقتصادی در محافل علمی و سیاست گذاری بوده است. این سیاستدر سال ۱۳۹۲ توسط مجلس شورای تصویب و بر اساس بودجه سال ۱۳۹۳ اجرایی شد. هدف بررسی پژوهش حاضر بررسی تاثیر خبر افزایش قیمت خوراک پتروشیمی بر شاخص‌های بازار سهام تهران است. در این تحقیق داده‌های سری‌زمانی به صورت روزانه، از تاریخ ۱/۷/۹۱ تا ۳۰/۷/۹۳ از طریق مدل‌های خانواده ARCH و با استفاده از متغیرهای مجازی تحلیل شده است. یافته‌های الگو مبین اثر معنادار خبر افزایش قیمت خوراک پتروشیمی قبل از تصویب بر شاخص‌های بازار سهام تهران است که بازدهی این صنعت را با روند مثبتی تحت تاثیر قرار داده است.

کلمات کلیدی:
واژه های کلیدی:خبر،شاخص بازار سهام، سری زمانی، مدل هایARCH, طبقه بندی JEL : C۳۲, G۱۴, M۴۸

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:
https://civilica.com/doc/1570289