

عنوان مقاله:

بررسی عوامل موثر بر تغییرات بازده سهام در منتخبی از شرکت های پتروشیمی و پالایشی پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از مدل خود رگرسیون برداری با وقفه توزیعی (ARDL)

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی توانمندی مدیریت، مهندسی صنایع، حسابداری و اقتصاد (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

نویسندگان:

سیدمحمد جوادی - استادیار گروه حسابداری و علوم مالی نفت، دانشکده نفت تهران، دانشگاه صنعت نفت

عسگر خادم وطنی - استادیار گروه اقتصاد و مدیریت انرژی، دانشکده نفت تهران، دانشگاه صنعت نفت

میلاذ آب یار - دانشجوی کارشناسی ارشد مالی - تامین مالی و سرمایه گذاری در نفت و گاز، دانشگاه صنعت نفت

خلاصه مقاله:

تحقیقات اخیر نشاندهنده آن است که گرایش احساسی سرما به گذار نقش مهمی در تعیین قیمت ها و تبیین بازده به خصوص برای سهامهایی که از ارزشی بالاتری برخوردارند و محدودیت زیادی در آربیتراژ دارند بازی میکند. هدف از انجام این تحقیق بررسی رابطه و میزان اثرگذاری بین تغییرات قیمت نفت و احساسات سرمایه گذاران با بازده سهام در شرکت های پتروشیمی و پالایشی است. برای رسیدن به چنین هدفی، از تحلیل آماری دادهها در این پژوهش از مدل خود رگرسیون برداری با وقفه توزیعی (ARDL) استفاده شده است. جامعه آماری تحقیق شرکت های پتروشیمی و پالایشی پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران است. نمونه انتخابی در بازه زمانی ۱۳۸۵-۱۳۹۹، با توجه به فیلترهای تعیین شده، ۱۵ شرکت از جامعه آماری مذکور است. نتایج انجام این پژوهش نشان می دهد که تغییرات قیمت نفت و احساسات سرما به گذاران با بازده سهام در شرکت های پتروشیمی و پالایشی پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار تهران ارتباط معنی دار دارد.

کلمات کلیدی:

تغییرات قیمت نفت؛ احساسات سرما به گذاران؛ بازده سهام؛ ARDL

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1691414>

