

عنوان مقاله:

مدل سازی و تاثیر شوک های اقتصادی بر بازده سهام صنایع غذایی

محل انتشار:

مجله علوم و صنایع غذایی ایران، دوره 19، شماره 124 (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

amir dadrasmoghadam - Assistant Professor, University of Sistan and Baluchestan

Seyed Mahdi Hosseini - Assistant Professor, University of Sistan and Baluchestan

Mohammad Hossein Karim - Associate Professor, Department of Resource Economics, Kharazmi University, Tehran, Iran

حسین بدیع فرزین - PhD student in Agricultural Economics, University of Sistan and Baluchestan

Mohammad Norouzian - PhD student in Agricultural Economics, University of Sistan and Baluchestan, norouzianali@pgs.usb.ac.ir

خلاصه مقاله:

هدف این پژوهش مدل سازی و تاثیر شوک های اقتصادی بر بازده سهام صنایع غذایی در طی دوره زمانی ۱۳۹۰ تا ۱۳۹۸ است. در این پژوهش به مدل سازی متغیرهای کلان اقتصادی بهینه بر بازده سهام شرکت های غذایی با استفاده از روش تابع تقریب الگوریتم ژنتیک پرداخته شده و سپس با روش خود رگرسیون برداری پانل تکانه ها و شوک های متغیرهای کلان اقتصادی موثر بر بازده سهام صنایع غذایی تجزیه و تحلیل شده است. در ابتدا با روش الگوریتم تقریب تابع ژنتیک، چهار متغیر قیمت نفت اوپک، حجم نقدینگی، قیمت زمین و شاخص قیمت سهام از میان هشت متغیر کلان اقتصادی به عنوان متغیرهای تاثیرگذار در مدل رگرسیون بهینه شناسایی شدند. قیمت نفت اوپک و قیمت زمین تاثیر منفی و معناداری بر بازده سهام شرکت های غذایی داشته در حالی که حجم نقدینگی و شاخص قیمت سهام تاثیر مثبت و معناداری بر بازده سهام شرکت های غذایی دارند. با توجه به توابع عکس العمل آبی، واکنش بازده سهام نسبت به قیمت نفت اوپک و حجم نقدینگی در ابتدا مثبت بوده است. در روش تجزیه واریانس، بیشترین سهم ناشی از شوک بازده سهام صنایع غذایی به خودش بوده و بعد از آن مربوط به حجم نقدینگی است. با توجه به تاثیر مثبت حجم نقدینگی بر بازده سهام شرکت های صنایع غذایی، پیشنهاد می شود سیاستگذاران و برنامه ریزان به منظور توسعه سرمایه گذاری صنایع غذایی، سیاست های را اعمال کنند تا حجم نقدینگی را به سمت شرکتهایی صنایع غذایی افزایش دهند.

کلمات کلیدی:

Food industry stock returns, liquidity volume, genetic algorithm approximation function, panel vector auto regression
بازده سهام صنایع غذایی، حجم نقدینگی، تابع تقریب الگوریتم ژنتیک، خود رگرسیون برداری پانل

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1828697>



