

عنوان مقاله:

بررسی تأثیرات شوک قیمت نفت خام بر بازار بورس تهران طی دوره ۱۳۷۵ تا ۱۴۰۰ با استفاده از آزمون هم انباشتگی و مدل VAR

محل انتشار:

چهارمین کنفرانس بین المللی نوآوری در مدیریت کسب و کار و اقتصاد (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

سعید دهقان خاوری - استادی ار و عضو هیئت علمی گروه اقتصاد دانشگاه میبد، یزد، ایران

فائزه ظهیری - کارشناسی اقتصاد، دانشگاه میبد، یزد، ایران

نجمه سادات امامی میبدی - کارشناسی اقتصاد، دانشگاه میبد، یزد، ایران

مریم سلطانی - کارشناسی اقتصاد، دانشگاه میبد، یزد، ایران

غزاله نوروزی هارونی - کارشناسی اقتصاد، دانشگاه میبد، یزد، ایران

خلاصه مقاله:

وابستگی اقتصاد ایران به درآمدهای نفتی و اثرگذاری قیمت آن بر بخش های مختلف اقتصادی کشور موجب می شود بررسی نوسانات آن حائز اهمیت باشد. همچنین این اثر می تواند بر بازار سرمایه به عنوان یکی از ارکان مهم اقتصاد ایران که صنایع مرتبطی همچون پتروشیمی و فرآورده های نفتی دارد، از اهمیت بیشتری برخوردار باشد. بنابراین توجه به نقش پررنگ نفت و میزان فروش و قیمت آن در اقتصاد ایران و همچنین تمایل عموم مردم و فعالان اقتصادی و سرمایه گذاران خارجی به فعالیت در بورس اوراق بهادار تهران، بررسی رابطه تغییرات قیمت نفت خام و ارزش بورس موضوعی قابل توجه به نظر می رسد. این مطالعه به هم انباشتگی و رابطه علت و معلولی بین قیمت نفت خام و بورس اوراق بهادار تهران با استفاده از داده های سالانه و طی دوره زمانی ۱۳۷۵-۱۴۰۰ پرداخته است. نتایج نشان دهنده ی ارتباط هم انباشتگی میان متغیرها می باشد. در واقع، وجود هم انباشتگی بیان می کند در انتقال تغییرات قیمت نفت به بورس عدم تقارن وجود دارد. همچنین نتایج به دست آمده از مدل VAR نشان می دهد که طی بازه ی مورد بررسی شوک های نفتی تأثیر چندانی بر ارزش بورس ندارد اما شوک های وارد شده بر قیمت سکه و همچنین نرخ ارز، تأثیر قوی بر ارزش بورس داشته است که با نتایج حاصل از واریانس تجزیه بورس نیز مطابقت دارد.

کلمات کلیدی:

نوسانات قیمت نفت، شاخص کل بورس اقتصاد ایران، VAR، هم انباشتگی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1949516>

