

عنوان مقاله:

بررسی تطبیقی اثر نوسانات قیمت نفت بر شاخص بازار بورس در کشورهای صادر کننده و وارد کننده نفت (مطالعه کشورهای ایران و آلمان)

محل انتشار:

کنفرانس ملی حسابداری، مدیریت مالی و سرمایه گذاری (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 21

نویسندگان:

غلامرضا عباسی - استادیار دانشکده اقتصاد و حسابداری دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران مر

مجتبی شفقت - دانشجوی کارشناسی ارشد توسعه اقتصادی دانشگاه آزاد تهران مرکز

خلاصه مقاله:

با توجه به اهمیت فراوان در آمدهای نفتی و سهم عمده آن در درآمدهای کشور، قیمت نفت از عوامل مهم و تاثیرگذار و مهم بر اقتصاد کشور به شمار میرود. از سوی دیگر بازارهای مالی و بویژه بازار بورس با جمع آوری نقدینگی بخش خصوصی و بازگرداندن پس از اندازهها به اقتصاد کشور نقش پررنگی را در روند رشد اقتصادی کشور ایفا میکند. این مقاله به منظور بررسی مقایسه ای اثر نوسانات قیمت نفت بر شاخص بازار بورس در کشور ایران به عنوان صادر کننده نفت و دو کشور آلمان به عنوان قطب صنعتی اروپا و جهان به عنوان واردکننده نفت در طی سالهای 2000 تا 2010 با داده ای ماهانه انجام شده است در این بررسی با از روش خود رگرسیون برداری VAR-GARCH برای بررسی این تاثیرات انجام شده است. بر اساس نتایج این مقاله نوسانات قیمت نفت اثرات پایدارتری را بر شاخص بازار بورس کشور ایران بر جای میگذارد و نقش پررنگ تری را در بلند مدت بر روند شاخص بازار بورس ایفا میکند. یافته های تجربی این مقاله، دلالتهای مفیدی را برای سرمایه گذاران و سیاست گذارانی که نیازمند تشخیص اثرات دقیق تغییرات قیمت نفت بر روی بازده سهام هستند فراهم میکند

کلمات کلیدی:

نوسانات قیمت نفت، شاخص بازار سهام، روش VAR-GARCH

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/196204>

