

عنوان مقاله:

بررسی رابطه بین قیمت گاز طبیعی و قیمت سهام شرکت های پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار: مطالعه موردی صنایع پتروشیمی ایران

محل انتشار:

دومین همایش ملی انرژی های نو و پاک (سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 17

نویسندگان:

حسن فرازمند - دانشیار اقتصاد دانشگاه شهید چمران

نرگس عبداللهی - کارشناس ارشد علوم اقتصادی دانشگاه شهید چمران اهواز

خلاصه مقاله:

این مقاله به بررسی روابط بلندمدت و کوتاه مدت بین قیمت گاز طبیعی و قیمت سهام صنعت پتروشیمی با استفاده از آزمون همگرایی جوهانسون و جوسلیوس و تصحیح خطای برداری (VECM)، در دوره 1376:1 تا 1390:12 می پردازد. نتایج برآورد نشان می دهد تاثیر قیمت گاز طبیعی، شاخص تولیدات صنعتی و نرخ ارز بر روی قیمت سهام پتروشیمی در بلندمدت منفی و معنی دار است ولی بر اساس مدل تصحیح خطای برداری، ارتباط معنی داری بین قیمت گاز طبیعی، شاخص تولیدات صنعتی، نرخ ارز و قیمت سهام صنعت پتروشیمی در کوتاه مدت وجود ندارد و تنها از رفتار خودش با یک دوره وقفه تاثیر می پذیرد. همچنین آزمون علیت تودا-یاماموتو نشان می دهد یک رابطه علی یک سویه از نرخ ارز و قیمت سهام صنایع پتروشیمی به قیمت گاز طبیعی وجود دارد در حالی که رابطه علی بین قیمت گاز طبیعی و شاخص تولیدات صنعتی دوسویه است. طبقه بندی JEL: O4، O52، G1، C3

کلمات کلیدی:

قیمت گاز طبیعی، قیمت سهام، فعالیت های اقتصادی، هم انباشتگی، صنایع پتروشیمی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/277090>

