

عنوان مقاله:

بررسی رابطه بین نرخ ارز، شاخص تولیدات صنعتی و قیمت سهام شرکتهای پذیرفته شده در بورس اوراق بهادار: مطالعه موردی صنایع پتروشیمی ایران (مستخرج شده از پایان نامه ی کارشناسی ارشد)

محل انتشار:

اولین کنفرانس بین المللی حماسه سیاسی (با رویکردی بر تحولات خاورمیانه) و حماسه اقتصادی (با رویکردی بر مدیریت و حسابداری)
(سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

حسن فرازمنند - دانشیار، دانشکده اقتصاد و علوم اجتماعی، دانشگاه شهید چمران اهواز

نرگس عبدالهی - کارشناس ارشد علوم اقتصادی دانشگاه شهید چمران اهواز

خلاصه مقاله:

این مقاله، به بررسی روابط بلندمدت و کوتاه مدت بین نرخ ارز، شاخص تولیدات صنعتی و قیمت سهام صنعت پتروشیمی با استفاده از آزمون هم گرایی جوهانسون و جوسلیوس و تصحیح خطای برداری (VECM)، در دوره ی 1376:1 تا 1390:12 می پردازد. نتایج برآورد نشان می دهد تأثیر نرخ ارز بر روی قیمت سهام پتروشیمی در بلندمدت منفی و معنی دار است اما، شاخص تولیدات صنعتی اثر معنی داری بر متغیر وابسته در بلندمدت ندارد. بر اساس مدل تصحیح خطای برداری نیز ضرایب کوتاه مدت متغیرها برآورد گردید. هم چنین، آزمون علیت تودا-یاماموتو نشان می دهد یک رابطه علی یک سویه از نرخ ارز و شاخص تولیدات صنعتی به سمت قیمت سهام صنایع پتروشیمی وجود دارد. طبقه بندی Q4 ، O52 ، G1 JEL، C3

کلمات کلیدی:

قیمت سهام- فعالیت های اقتصادی- هم انباشتگی- صنایع پتروشیمی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/495806>

