

عنوان مقاله:

بررسی تاثیر قیمت نفت بر شاخص قیمت سهام صنایع شیمیایی بر پایه مدل GARCH

محل انتشار:

سومین کنفرانس بین المللی مدیریت چالشها و راهکارها (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 6

نویسندگان:

مریم شفیعی کاخکی

مهدی ملک زاده

خلاصه مقاله:

هدف این مقاله بررسی تاثیر قیمت نفت بر شاخص قیمت سهام گروه صنایع شیمیایی در بورس اوراق بهادار تهران است. به منظور بررسی تاثیر نوسانات قیمت نفت بر شاخص سهام صنایع شیمیایی از طریق تجزیه و تحلیل سری زمانی طی دوره زمانی 1385-1393 با بکارگیری داده های هفتگی و تکنیک اقتصاد سنجی خود توضیح با واریانس ناهمسان شرطی تعمیم یافته (مدل GARCH) استفاده شده است. نتایج تحقیق نشان داد اثر ARCH در گروه صنایع شیمیایی وجود دارد. تاثیر قیمت نفت بر شاخص قیمت سهام گروه صنایع شیمیایی از نظر اماری معنی دار نبوده است. ولی با توجه به نتایج برآورد مدل GARCH اطلاعات گذشته تاثیر و مثبت و معنی داری برای پیش بینی نوسانات شاخص قیمت سهام در دوره های بعد دارد.

کلمات کلیدی:

شاخص قیمت سهام صنایع، مدل GARCH، مدل ARCH

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/507689>

