

عنوان مقاله:

بررسی تاثیر تغییرات و نوسانات قیمت نفت بر بورس اوراق بهادار تهران

محل انتشار:

دومین همایش بین المللی انسجام مدیریت و اقتصاد در توسعه (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

رسول سجاد - استادیار مهندسی مالی

فاطمه شهسواری گوغری - دانشجوی کارشناسی ارشد رشته صنایع

خلاصه مقاله:

نفت یکی از منابع مهم درآمدی برای کشورهای صادرکننده نفت میباشد. به طوری که انتظار میرود تغییرات در بازار نفت بر دیگر بخشهای اقتصاد تاثیرگذار باشد. در این پژوهش به بررسی تاثیر تغییرات و نوسانات قیمت نفت و تاثیر آن بر بورس اوراق بهادار تهران پرداخته میشود. همچنین تقارن و یا عدم تقارن شوکهای مثبت و منفی حاصل از متغیرهای مدل بر شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران نیز مورد بررسی قرار میگردد. برای این منظور از مدلهای خانواده گارچ استفاده شده است. این مدلها شامل مدلهای GJR و ARCH، GARCH می باشد. نتایج حاصل از برآورد مدلهای پژوهش نشان از ارتباط منفی بین قیمت نفت و شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران میباشد. همچنین نتایج نشان داد که تاثیر شوکهای وارده از متغیرهای مدل بر شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران به صورت متقارن میباشد. به عبارتی نتایج نشان داد که شوکهای مثبت و منفی دارای تاثیر مشابهی بر بورس اوراق بهادار دارد.

کلمات کلیدی:

نوسان قیمت نفت، تاثیر متقارن شوکها، بورس اوراق بهادار تهران، مدل گارچ

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/716138>

