

عنوان مقاله:

بررسی تاثیر تولید ناخالص داخلی بر شاخص قیمت سهام بورس اوراق بهادار

محل انتشار:

اولین همایش ملی رویکردهای نوین در حسابداری و مدیریت (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

پریسا جنت خواه - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت بازرگانی، واحد علوم و تحقیقات آذربایجان شرقی، دانشگاه آزاد اسلامی، تبریز،
ایران

محمد رضا ناهیدی امیرخیز - گروه اقتصاد، واحد تبریز، دانشگاه آزاد اسلامی، تبریز، ایران

خلاصه مقاله:

در پژوهش حاضر تاثیر تولید ناخالص داخلی بر شاخص قیمت سهام مورد بررسی قرار گرفته است. بدین منظور از داده های فصلی دو متغیر شاخص قیمت سهام و تولید ناخالص داخلی در فاصله زمانی سال های 1383 تا 1391 استفاده شد که ضمن بررسی پایایی متغیرها و انجام آزمون ناهمسانی واریانس با استفاده از مدل عدم تقارن EGARCH (نمایی)، مدل مورد ارزیابی قرار گرفت. نتیجه برآورد مدل با استفاده از روش تعیین شده، نشانگر وجود رابطه معنادار بین متغیر مستقل و متغیر وابسته می باشد. همچنین نتایج نشان داد که تولید ناخالص داخلی اثر مثبت بر شاخص قیمت سهام دارد یعنی با افزایش یک درصد در تولید ناخالص داخلی، قیمت سهام به میزان 4,2 واحد افزایش مییابد.

کلمات کلیدی:

شاخص قیمت سهام، تولید ناخالص داخلی، الگوی ناهمسانی شرطی، EGARCH.

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/726000>

