

عنوان مقاله:

اثرات تکانه های قیمت نفت بر روی نوسانات شاخص قیمت سهام تهران

محل انتشار:

چهارمین کنفرانس ملی رویکردهای نوین در علوم مدیریت ، اقتصاد و حسابداری (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

مهناز ربیعی - استادیار دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران جنوب

رضا رهبر - دانشجوی کارشناسی ارشد علوم اقتصادی دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران جنوب

خلاصه مقاله:

هدف از تحقیق حاضر بررسی اثرات تکانه های مثبت و منفی قیمت نفت بر روی نوسانات شاخص قیمت سهام در بورس اوراق بهادار تهران در بازه زمانی 1362-1392 و جامعه آماری مورد مطالعه نیز اقتصاد ایران میباشد. در این پژوهش از آزمون ریشه واحد دیکی فولر تعمیم یافته برای آزمون مانایی متغیرها، الگوی خود رگرسیون برداری برای نشان دادن اثرات و نامتقارن بودن تکانه های قیمت نفت بر روی نوسانات شاخص قیمت سهام، اثر تکانه های مثبت و منفی به تفکیک، از طریق تابع عکسالعمل آنی حاصل از الگوی خود رگرسیون برداری و همچنین از تجزیه واریانس برای بررسی عملکرد پویای بین متغیرها استفاده میشود. در این تحقیق از روش تجزیه واریانس برای بررسی وجود تقارن یا عدم تقارن در واکنش نوسانات شاخص قیمت سهام نسبت به شوکهای مثبت و منفی قیمت نفت و برای تجزیه و تحلیل داده نیز از نرم افزار Eviews استفاده میگردد. نتایج پژوهش نشان میدهد که تکانه های مثبت و منفی قیمت نفت در کوتاه مدت به صورت هم جهت ولی در بلندمدت به صورت غیر هم جهت بر روی نوسانات شاخص قیمت سهام در ایران اثر میگذارند و درصد اثری که تکانه های مثبت و منفی نفت بر روی نوسانات شاخص قیمت سهام دارند با یکدیگر برابر نمیشوند. همچنین در ماه دوم تا ماه دوازده پس از رخ دادن یک تکانه منفی، بین 1/17 الی 12/82 درصد از تغییرات در نوسانات شاخص قیمت سهام در واکنش به تکانه های منفی نفتی میباشد، در حالی که در ماه دوم تا ماه دوازده پس از رخ دادن یک تکانه مثبت تنها بین 0/0002 تا 0/74 درصد از تغییرات در نوسانات شاخص قیمت سهام در واکنش به تکانه مثبت نفتی بوده است.

کلمات کلیدی:

نوسانات شاخص قیمت سهام تهران، اثرات تکانه های قیمت نفت

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/737932>

