

تأثیر شوک های قیمتی نفت بر نقدشوندگی و بازدهی در بازار اوراق بهادار تهران

عباس علیمرادی

استاد دانشگاه صنعت نفت رشته مدیریت مالی

چکیده

هدف از این پژوهش بررسی تأثیر شوک های قیمتی نفت بر نقدشوندگی بازار سهام و عملکرد آن در بورس اوراق بهادار تهران می باشد. این پژوهش از مدل Multivariate GARCH برای بررسی این رابطه استفاده کرده است و همپنین داده ها و اطلاعات مورد نیاز برای محاسبه متغیرها مربوط به دوره زمانی سال ۱۳۸۸-۱۳۹۷ می باشد. یافته های این پژوهش حاکی از وجود رابطه معنادار و منفی بین شوک های قیمتی نفت و عملکرد بازار سهام می باشد، همچنین نتایج این پژوهش هیچگونه رابطه معناداری بین شوک های قیمتی نفت و نقدشوندگی بازار سهام را نشان نمی دهد.

واژه های کلیدی: نقدشوندگی بازار سهام، شوک قیمتی نفت، عملکرد بازار سهام، گارچ چند متغییره

مطالعات اقتصاد، مدیریت مالی و حسابداری

دوره ۶، شماره ۳، پاییز ۱۳۹۹، صفحات ۳۱-۴۲