

عنوان مقاله:

تئوری ارزش فرین و ارزش در معرض ریسک: کاربردی از بازار نفت اوپک

محل انتشار:

فصلنامه پژوهشنامه اقتصاد انرژی ایران، دوره 8، شماره 31 (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

مهتاب مهراسا - دانشجوی دکتری دانشگاه علامه طباطبائی

تیمور محمدی - دانشیار گروه اقتصاد نظری، دانشکده اقتصاد، دانشگاه علامه طباطبائی

خلاصه مقاله:

با توجه به نقش بازار انرژی به ویژه نفت بر اقتصاد کشورها، شناخت تحولات آتی این بازار دارای اهمیت است. در همین راستا، پیش بینی تحولات حدی متغیر قیمت نفت برای تصمیم گیران و سیاست گذاران دارای اهمیتی دو چندان می باشد. هدف این مطالعه، بررسی حداکثر تغییرات قیمت سبد نفت اوپک با استفاده از مفهوم ارزش در معرض ریسک [۱] است. برای محاسبه این معیار از مدل های خانواده GARCH مبتنی بر توزیع نرمال و فرین استفاده شده که انتظار می رود تمرکز بر توزیع فرین در پیش بینی ارزش در معرض خطر به ویژه در مواجهه با وقایع حدی، نتایج واقع بینانه تری داشته باشد. نتایج پس آزمایی [۲] مدل ها، نشان داده که مدل ARMA-GARCH- EVT در مقایسه با سایر موارد، پیش بینی بهتری ارائه نموده است. [۱]. Value-at-Risk (VaR) [۲]. Backtesting

کلمات کلیدی:

تئوری ارزش فرین، ارزش در معرض ریسک، گارچ، قیمت نفت

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1190112>

