

## عنوان مقاله:

آیا نااطمینانی حاصل از نوسانات قیمت نفت خام بر عرضه ی آن موثر است؟ کاربردی از GARCH و ARDL

## محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات اقتصادی، دوره 45، شماره 2 (سال: 1389)

تعداد صفحات اصل مقاله: 28

## نویسندگان:

Esmail Abounoori - اقتصاد دانشگاه مازندران

امیر خانعلی پور - مدرس مدعو دانشگاه پیام نور - مرکز زنجان

## خلاصه مقاله:

افزایش شدید قیمت نفت خام و نوسانات آن در دهه های اخیر سبب جلب توجه بسیاری از پژوهشگران به حوزه ی انرژی شده است. به نظر می رسد علاوه بر اثر مستقیم قیمت نفت خام، نااطمینانی حاصل از نوسانات قیمت نیز بر عرضه ی نفت خام اثر گذار باشد. در این پژوهش اثر نااطمینانی قیمت نفت خام بر عرضه ی آن با استفاده از داده های سری زمانی ماهانه ی ژانویه، ۱۹۸۰ تا سپتامبر ۲۰۰۷ برای کشورهای ایران، عربستان، لیبی و نیجریه و داده های ماهانه ی مارس ۱۹۸۱ تا سپتامبر ۲۰۰۷ برای کشور انگلستان بررسی شده است. ابتدا با استفاده از الگوی ناهمسان واریانس شرطی تعمیم یافته (GARCH) نااطمینانی حاصل از نوسانات قیمت واقعی نفت، محاسبه و سپس ضرایب بلند مدت مدل برای هر کشور و به طور مجزا به وسیله ی الگوی خود بازگشت وقفه ی توزیعی برآورد شده است. نتایج حاصل حاکی از وجود اثر مثبت و معنی دار در عربستان و لیبی، ولی منفی و معنی دار برای انگلستان می باشد، در حالی که این اثر در ایران و نیجریه معنی دار نبوده است. این نتیجه نشان می دهد این است که اثر نااطمینانی قیمت نفت خام بر عرضه ی آن، به شکل تابع مطلوبیت آن بستگی دارد. طبقه بندی JEL: C۲۲، C۳۲، C۵۲، G۱۴

## کلمات کلیدی:

عرضه ی نفت، قیمت نفت، نااطمینانی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1309554>

