

عنوان مقاله:

پیش بینی میزان ارزش در معرض خطر قیمت نفت

محل انتشار:

فصلنامه نظریه های اقتصاد مالی، دوره 3، شماره 2 (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

نویسندگان:

هادی حیدری

اعظم احمدیان - پژوهشگر پوی و بانکی

خلاصه مقاله:

نفت خام یکی از منابع و مهمترین منبع ایجاد درآمد در کشور است که نوسانات قیمت آن، باعث ایجاد بی ثباتی درآمد نفتی و در نتیجه بی ثباتی اقتصادی در کشور خواهد شد. با توجه به اهمیت موضوع، هدف این مقاله برآورد ارزش در معرض خطر قیمت نفت است. برای این منظور از روش ترکیبی EGARCH-EVT ARMA - استفاده شده است. داده های موردبررسی، قیمت نفت برنت برای بازه زمانی سال ۲۰۰۰ تا ۲۰۱۴ است. نتایج بررسی و آزمون های دقت مدل نشان می دهد که استفاده از تئوری نقاط فرین با مدل های خانواده گارچ برای شناسایی مقادیر بدبینانه قیمت نفت عملکرد مناسبی را در قیاس با داده های تحقق یافته دارند.

کلمات کلیدی:

Value at Risk, GARCH Family Model, Christoffersen Test, ارزش در معرض خطر, مدل خانواده گارچ, آزمون کریستوفرسن.

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1514602>

