

عنوان مقاله:

تحلیل تاثیرپذیری نوسانات قیمت طلا بر روی قیمت جهانی نفت با استفاده از مدل های ARCH

محل انتشار:

همایش ملی سلحشوران دفاع مقدس (سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

مصطفی جهانتیغ الهی - دانشجوی کارشناسی ارشد توسعه اقتصادی و برنامه ریزی و برنامه ریزی دانشگاه آزاد اسلامی خمینی شهر

محمدعلی اسلامی - دانشجوی کارشناسی ارشد توسعه اقتصادی و برنامه ریزی و برنامه ریزی دانشگاه آزاد اسلامی خمینی شهر

اکبر محمدی ده چشمه - دانشجوی کارشناسی ارشد توسعه اقتصادی و برنامه ریزی و برنامه ریزی دانشگاه آزاد اسلامی خمینی شهر

خلاصه مقاله:

هدف از این مطالعه بررسی تغییرات قیمت طلا و مدلسازی نوسانات بازده و واریانس شرطی این متغییر بر روی قیمت نفت در دوره (5) 1389 - (1) 1380 ایران پرداخته میشود، که بررسی سری زمانی مذکور نشان داد این سری دارای نوسانات خوشه ای بوده که این امر استفاده از مدل های ARCH جهت مدلسازی نوسانات را امکان پذیر می نماید. نتایج تجربی نشان میدهد که یکپارچگی متعادل میان نوسانات قیمت طلا و قیمت نفت وجود دارد و این نشان از وجود روابط بلند مدت پایدار میان این متغییرها می باشد به این منظور ابتدا شاخص نااطمینانی ناشی از نوسانات قیمت طلا از مدل IGARCH برآورد، سپس روابط متقابل متغییرهای مدل با استفاده از مدل خود توضیح برداری بررسی و در ادامه رابطه بلند مدت بین متغییرها نیز با استفاده از تکنیک هم انباشتگی یوهانسن- جوسیلیوس استخراج میشود و همچنین روابط دوطرفه بین متغییرها با استفاده از آزمون گرنجر صورت میگیرد. نتایج تحقیق حاضر با توجه به داده های سری زمانی و متغییرهای مورد نظر، وجود رابطه بلند مدت میان نااطمینانی قیمت طلا و قیمت نفت را نشان میدهد. و در طی دوره نوسانات قیمت طلا با شیب منفی به سمت تعادل بلند مدت پیش می رود و همچنین نتایج حاصل از علیت گرنجر وجود رابطه یک طرفه بین متغییرها را بیان میکند.

کلمات کلیدی:

قیمت نفت، قیمت طلا، واریانس ناهمسانی شرطی اتورگرسیو تعمیم یافته انباشته، الگوی خود توضیح برداری (VAR)، علیت گرنجر

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/278049>

