

عنوان مقاله:

یک رویکرد بوت استرپ برای آزمون علیت میان نرخ ارز موثر حقیقی و قیمت نفت در کشورهای منتخب صادر کننده و وارد کننده نفت خام

محل انتشار:

همایش ملی پژوهش های دانش بنیان در صنایع نفت، گاز، پالایش و پتروشیمی (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

امین شلتوک کوب ثانی - کارشناس ارشد اقتصاد انرژی، دانشکده اقتصاد و مدیریت، دانشگاه ارومیه

خلیل جهانگیری - استادیار گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد و مدیریت، دانشگاه ارومیه

علی رضازاده - استادیار گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد و مدیریت، دانشگاه ارومیه

خلاصه مقاله:

هدف اصلی مطالعه حاضر بررسی علیت میان نرخ ارز موثر حقیقی و قیمت نفت به تفکیک در کشورهای صادر کننده و وارد کننده نفت خام است. نمونه مورد مطالعه در قالب دو گروه کشورهای وارد کننده و صادر کننده نفت خام (کشورهای غیر اروپایی) تقسیم بندی شده و دوره زمانی تحقیق نیز از سال 1990 تا 2017 می باشد. در این راستا ابتدا آزمون های همبستگی بین مقاطع و آزمون های همگنی ضرایب استخراج شده و سپس براساس آزمون علیت پانلی که توسط موتاسکو (2016) ارائه شده و مبتنی بر رگرسیون های به ظاهر نامرتب (SUR) و آزمون های والد با مقادیر بحرانی بونت استرپ هر کشور است، مورد بررسی قرار گرفته است. نتایج پژوهش نشان می دهد که علیت بین نرخ ارز موثر حقیقی و قیمت نفت در کشورهای مختلف صادر کننده و وارد کننده با یکدیگر متفاوت است. همچنین نتایج پژوهش نشان می دهد که در کشورهای صادر کننده از جمله مکزیک و روسیه رابطه علیت از سوی قیمت نفت خام به نرخ ارز وجود دارد و در کشورهای وارد کننده از جمله چین، ساحل اچ، مراکش، سنگاپور و تریندادو توباگو رابطه علیت از سوی قیمت نفت خام به نرخ ارز وجود دارد این در حالی است که در بقیه کشورها وجود ندارد.

کلمات کلیدی:

نرخ ارز، قیمت نفت، علیت، کشورهای صادر کننده نفت خام، کشورهای وارد کننده نفت خام

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1030906>

