

عنوان مقاله:

تاثیر بازار مالی بر قیمت نفت خام شاخص جهانی و ایران

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های سیاستگذاری و برنامه ریزی انرژی، دوره 2، شماره 1 (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 26

نویسندگان:

سید عبدالله رضوی - دانشگاه فردوسی

مصطفی سلیمی فر - دانشگاه فردوسی

سید مهدی مصطفوی - دانشگاه فردوسی

مرتضی بکی حسکوئی - دانشگاه علامه طباطبائی

خلاصه مقاله:

بررسی علل تغییر قیمت نفت و مدلسازی برای پیش بینی نوسانات آن، با توجه به جایگاه آن در اقتصاد ایران، همواره یکی از مهمترین حوزه های مطالعاتی ادبیات اقتصاد ایران بوده است. از سوی دیگر نوسان قیمت نفت، موجب ایجاد اختلالاتی در برنامه های توسعه می شود. لذا، شناخت ساز و کار شکل گیری قیمت های نفت می تواند ریسک نوسانات قیمت نفت و تاثیرات منفی آن بر اقتصاد ایران را کاهش دهد. در این مقاله به بررسی انحراف قیمت نفت خام از مسیر بلند مدت آن با توجه به روابط بین بازار های مورد نظر در کوتاه مدت پرداخته است. بدین منظور از مدل جهش قیمت فیشر استفاده شده است و از داده های سری زمانی روزانه سال های ۲۰۰۵-۲۰۱۳ در مورد قیمت نفت خام شاخص جهانی با روش تکنیک گارچ چند آزمون می گردد. نتایج نشان می دهد تاثیر تغییر شاخص بازار سرمایه بر قیمت نفت خام مثبت و نیز اثر تغییر شاخص بازار پول (نرخ بهره) بر این نفت خام منفی می باشند.

کلمات کلیدی:

Crude Oil, Interest Rate, Capital Market Index, نفت خام شاخص جهانی, شاخص

بازار سرمایه و نرخ بهره

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1455443>

