

بررسی رابطه بین نرخ ارز قیمت طلا و قیمت نفت خام در ایران طی دوره ۱۳۹۳ تا ۱۳۹۶

۱- مهدی خداپرست مشهدی ۲- اسامه العبودی ۳- احمد سراداری ترشیزی^۱

۱- دانشیار دانشکده اقتصاد دانشگاه فردوسی مشهد

۲- دانشجوی ارشد اقتصاد دانشگاه فردوسی مشهد

۳- دانشجوی ارشد اقتصاد دانشگاه فردوسی مشهد

چکیده

قیمت نفت همواره به عنوان یک شاخص پیشرو برای نوسانات نرخ ارز در اقتصاد جهانی و عامل رشد اقتصاد جهانی در نظر گرفته شده است. حرکات اخیر ارتباطات بین طلا و قیمت نفت باعث افزایش علاقه محققان به آزمودن و بررسی ارتباط بین قیمت نفت شده است و طلا به عنوان تغییرات قیمت خود دارای پیامدهای مهمی برای اقتصاد و بازارهای مالی می باشد. در این مقاله در ابتدا در قسمت اول (univariate) به کمک نرم افزار R مدل تک تک متغیرها برآورد و شکل آنها رسم شده و در قسمت دوم (Multivariate) به کمک نرم افزار Microfit ۴،۱ الگوی VAR برآورد شده و آزمون علیت گرنجری انجام شده و در نهایت به تفسیر نتایج حاصله می پردازد.

کلید واژه ها: نرخ ارز، الگوی خود توضیح برداری، علیت گرنجری، یوهانسون جوسلیوس

^۱ Corresponding author: دانشجوی ارشد اقتصاد دانشگاه فردوسی

Email: a_saradari@mail.um.ac.ir