

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

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

^۱ دانشیار دانشکده اقتصاد دانشگاه فردوسی مشهد

^۲ دانشجوی کارشناسی ارشد اقتصاد دانشگاه فردوسی مشهد

^۳ دانشجوی کارشناسی 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.

واژه‌های کلیدی: نرخ ارز، الگوی خود توضیح برداری، علیت گرنجری، یوهانسون جوسلیوس