

1

Date:

Sat Sun Mon Tue Wed Fri

Subject:

بسم الله الرحمن الرحيم

دوره اول

دوره دوم

موضوع اثر نرخ ارز روی قیمت نفت در ایران ()
گردآورندگان: (از زیرمضامین) فاطمه دهنی فاطمه کدیان فاطمه خورانی
استاد سرمدی استادی اسکار عرفان هاشمی
درس مربوطه اقتصاد سنجی مالی
دانشگاه ارومیه
تاریخ 14.4, 9, 1

دوره دوم و سوم

در اقتصاد ایران، نوسان نرخ ارز به طور مستقیم بر قیمت داخلی نفت تأثیر می گذارد زیرا بخش بزرگی از درآمدهای دولت از محل فروش نفت به ارز خارجی تأمین می شود. افزایش نرخ ارز معمولاً باعث رشد ارزش ریالی درآمدهای نفتی و در نتیجه تقویت قیمت گذاری انرژی در داخل کشور می شود. از طرف دیگر، ارزی و انتظارات دورتری را با بالایی نرخ ارز و این موضوع قیمت فزاینده ای در نفت و سیاست های انرژی دولت را تحت فشار قرار می دهد. در ایران، مزیت وابستگی جود به نفت بالاست و بنابراین، تغییرات نرخ ارز تأثیر عمیقی بر زندگی و شغل به کشورهای عادی بر بازار نفت دارد.
در ادامه، رابطه میان نرخ ارز و قیمت نفت در ایران (مدل اقتصادسنجی) را گردآوری و محاسبه کردیم. در ادامه خواهیم دید که افزایش نرخ ارز و نرخ ارز چند واقعیت مهم در قیمت را تغییر می دهد.

②

Date: / /

Sat. Sun. Mon. Tue. Thu. Wed. Fri.

Subject: -----

صفحه ۴

درخت رفت سال

درخت ارز سال

درخت سود

درخت مانده سال

درخت

	x	y
1394	3,445	46,74
1395	3,613	3,107
1396	4,1067	54,51
1397	9,387	49,108
1398	10,645	44,21
1399	21,084	41,114

محاسبه میانگین درخت ارز در سال 1394

$$\bar{x} = \frac{3,445 + 3,613 + 4,1067 + 9,387 + 10,645 + 21,084}{6} = 12$$

$$\frac{41,341}{12} = 3,445 \quad \bar{x} = 44 \text{ سال}$$

محاسبه میانگین درخت 95

$$\bar{x} = \frac{3,445 + 3,613 + 4,1067 + 9,387 + 10,645 + 21,084 + 3,445 + 3,613 + 4,1067 + 9,387 + 10,645 + 21,084}{12} = 12$$

Date:

(3)

Sat. Sun. Mon. Tue. Thu. Wed. Fri.

Subject: -----

مساحت میانگین 96

$$\bar{x} = 3,744 + 3,758 + 3,720 + 3,778 + 3,814 + 3,858 + 3,894 + 4,100 + 4,111 + 4,410 + 4,410 + 4,870$$

12

$$96 \bar{x} = \frac{48,111}{12} = 4,009$$

مساحت میانگین 97

$$\bar{x} = 4,400 + 4,400 + 4,490 + 4,520 + 10,500 + 10,900 + 14,424 + 14,420 + 9,940 + 11,420 + 11,550 + 12,190$$

12

$$97 \bar{x} = \frac{112,950}{12} = 9,412$$

مساحت میانگین 98

$$\bar{x} = 13,200 + 14,850 + 14,850 + 11,200 + 12,140 + 11,200 + 11,550 + 11,550 + 12,220 + 12,100 + 12,200 + 12,720$$

12

$$\bar{x} = \frac{126,490}{12} = 10,540$$

مساحت میانگین 99

$$\bar{x} = 12,700 + 14,000 + 14,400 + 22,100 + 22,500 + 31,800 + 25,200 + 24,600 + 24,900 + 25,700 + 24,900$$

12

$$\bar{x} = \frac{260,100}{12} = 21,675$$

(4)

Date: / /

Sat. Sun. Mon. Tue. Thu. Wed. Fri.

Subject: -----

محاسبه نرخ مبالغین صحت -

محاسبه من

نرخ

۵۰,۲۵

۴۷,۷۴

۹۴

مبالغین صحت -

۴۴,۵۹

۳۰,۵۷

۹۵

مبالغین صحت -

۴۴,۵۱

۹۶

۴۹,۰۱

۹۷

۴۴,۲۱

۹۸

۴۱,۸۴

۹۹

مبالغین ↑ صحت نرخ صحت در رهبر ارسال ۱۳۹۴ تا ۱۳۹۵ به نشانی

1399

1398

1397

1396

1395

1394

۴۴,۸۰

۴۸,۹۰

۴۷,۲۰

۵۴,۳۰

۴۱,۲

۵۷,۷۵

فروردین

۴۹,۵۱

۷۱,۲۰

۷۴,۸۰

۵۱,۵۰

۴۵,۸

۴۴,۹۲

اردیبهشت

۳۸,۲۰

۴۴,۵۰

۷۴,۴۰

۴۹,۴۰

۵۰,۴

۷۱,۹۷

خرداد

۴۳,۱۰

۴۵,۲۰

۷۷,۴۰

۴۸,۴۰

۴۵,۸

۵۲,۲۳

تیر

۴۵,۱۰

۵۹,۲۰

۷۳,۵۰

۵۱,۸۰

۴۵,۵

۴۴,۷۴

مرداد

۴۱,۱۰

۴۱,۱۰

۷۸,۱۰

۵۴,۲۰

۴۵,۲

۴۷,۳۸

مهر

۴۰,۸۰

۵۹,۲۰

۸۱,۴۰

۵۷,۵۰

۵۱,۸

۴۸,۳۰

آبان

۳۹,۷۰

۴۲,۰۰

۷۰,۲۰

۴۰,۴۰

۴۵,۵

۴۳,۷۴

آذر

۴۸,۷۰

۴۴,۲۰

۵۹,۲۰

۴۳,۱۰

۵۴,۹

۳۷,۴۳

دی

۵۴,۱۰

۴۴,۲۰

۵۷,۱۰

۴۴,۴۰

۵۵,۷

۴۱,۲۰

بهمن

۵۸,۲۰

۵۸,۲۰

۴۴,۴۰

۴۸,۵۰

۵۴,۴

۴۵,۸

اسفند

۴۴,۸۰

۵۰,۸۰

۴۴,۲۰

۴۴,۵۰

۵۵,۹

۵۰,۲۰

5

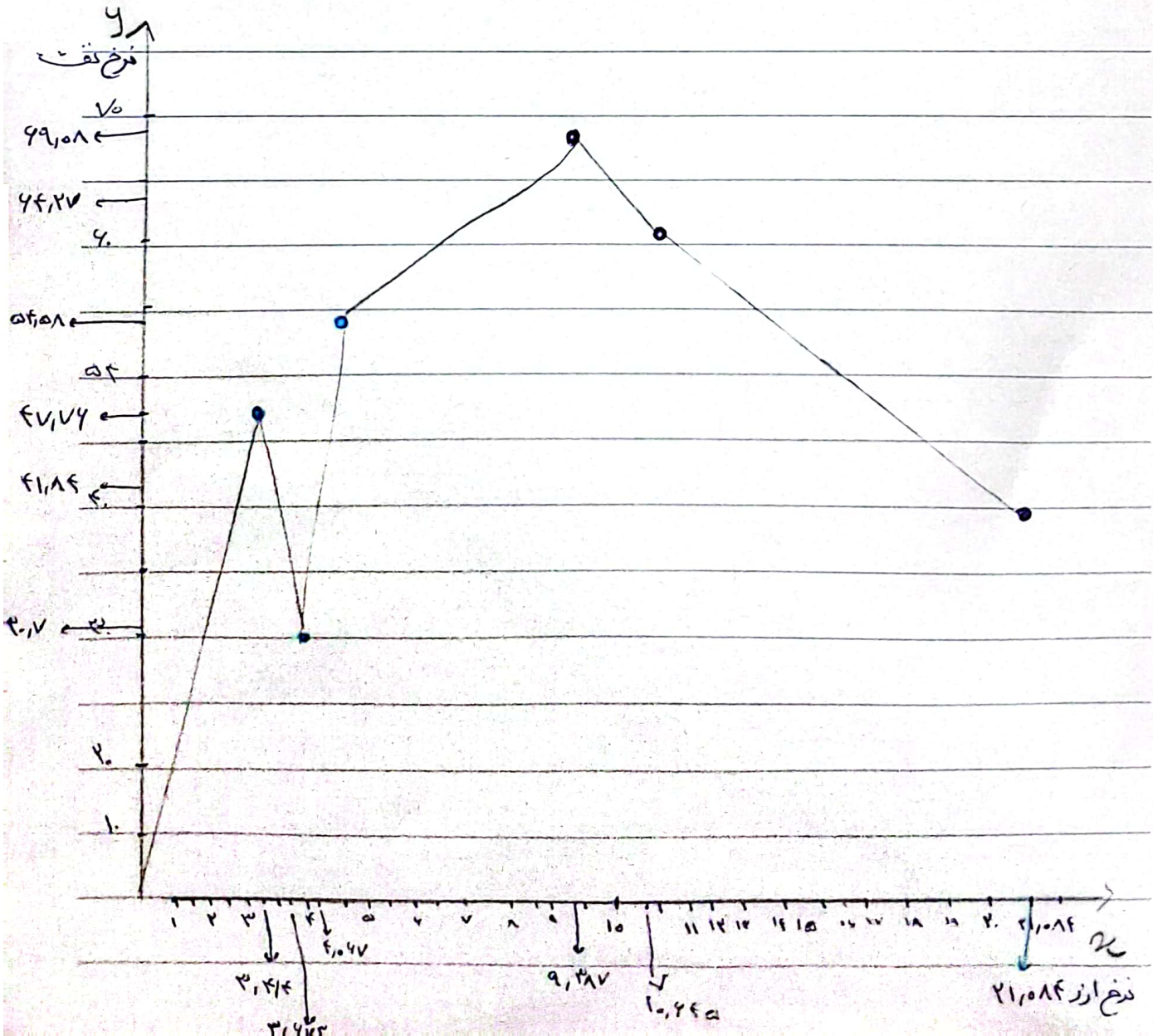
Date: / /

Sat. Sun. Mon. Tue. Thu. Wed. Fri.

Subject: -----

تدوین نمودار

	x y		
۹۴	3,445	47,76	روشنی
۹۵	3,673	30,07	
۹۶	4,067	54,58	Investing
۹۷	9,387	62,08	bloomberg
۹۸	10,645	64,27	
۹۹	21,084	41,84	



(6)

Date: / /

Sat	Sun	Mon	Tue	Thu	Wed	Fri
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

Subject: -----

$$y = B_0 + B_1 x + u$$

$$B_1 \text{ حساب } \Rightarrow$$

$$\left. \begin{array}{l} \text{میانگین از بالا} \\ \text{میانگین از پایین} \end{array} \right\} \bar{y} \Rightarrow \bar{x} = \frac{3,445 + 3,473 + 4,046 + 9,317 + 10,445 + 21,114}{4} = \frac{51,835}{4} = 12,95875$$

$$\bar{y} = \frac{46,174 + 30,107 + 54,511 + 49,011 + 44,211 + 41,114}{4} = \frac{265,128}{4} = 66,282$$

$$B_1 = \frac{\sum (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})}{\sum (x_i - \bar{x})^2} \Rightarrow$$

-0,3

$$\begin{aligned} & (3,445 - 12,95875)(46,174 - 66,282) + (3,473 - 12,95875)(30,107 - 66,282) + (4,046 - 12,95875)(54,511 - 66,282) \\ & (9,317 - 12,95875)(49,011 - 66,282) + (10,445 - 12,95875)(44,211 - 66,282) + (21,114 - 12,95875)(41,114 - 66,282) \end{aligned}$$

$$= (-9,51375)(-20,108) + (-9,48575)(-36,175) + (-8,91275)(-11,771) + (-3,64175)(-17,271) + (-2,51375)(-22,071) + (8,15525)(-25,168)$$

$$193,13 - 247,4 - 104,4 = 32,93$$

$$\begin{aligned} & (3,445 - 12,95875)^2 + (3,473 - 12,95875)^2 + (4,046 - 12,95875)^2 + (9,317 - 12,95875)^2 + (10,445 - 12,95875)^2 + (21,114 - 12,95875)^2 \\ & (-9,51375)^2 + (-9,48575)^2 + (-8,91275)^2 + (-3,64175)^2 + (-2,51375)^2 + (8,15525)^2 \end{aligned}$$

$$129 + 45 + 14 + 0,5 + 4 + 152,14 = 340,14$$

$$B_1 = \frac{32,93}{340,14} = 0,0968$$

درست است و باید

7

Date: / /

Sat. Sun. Mon. Tue. Thu. Wed. Fri.

Subject: -----

 B_0 error

$$y = B_0 + B_1(x)$$

$$B_0 = \bar{y} - B_1(\bar{x})$$

$$B_0 = 51,2 - (0,14)(1,1) = 51,2 - 1,54 = 49,6$$

$$B_0 = 49,6$$

 u error

$$y = B_0 + B_1(x) + u$$

$$u = y_p - y_i \Rightarrow$$

$$y_p = B_0 + B_1(x) \Rightarrow$$

$$49,6 + (0,14)(1,1) \Rightarrow 50,74$$

$$49,6 + (0,14)(1,1) \Rightarrow 50,74$$

$$49,6 + (0,14)(1,1) \Rightarrow 50,74$$

$$49,6 + (0,14)(1,1) \Rightarrow 50,74$$

$$49,6 + (0,14)(1,1) \Rightarrow 50,74$$

$$49,6 + (0,14)(1,1) \Rightarrow 50,74$$

$$y_p - y_i = u$$

$$50,74 - 49,64 = 1,1$$

$$50,74 - 49,64 = 1,1$$

$$50,74 - 49,64 = 1,1$$

$$50,74 - 49,64 = 1,1$$

$$50,74 - 49,64 = 1,1$$

$$50,74 - 49,64 = 1,1$$

$$1,1 + 1,1 - 1,1 - 1,1 - 1,1 + 1,1 = 0$$

(9)

Date: / /

Sat. Sun. Mon. Tue. Thu. Wed. Fri.

Subject: -----

$$T = 1 - \frac{SSR}{SST}$$

Rule

$$SSR = \sum (u_i)^2 = (1,4)^2 + (2,33)^2 + (-4,1)^2 + (-1,11)^2 + (-1,12)^2 + (1,35)^2 =$$

$$SSR = 9,74 + 14,7 + 13,3 + 14,12 + 14,18 = 91,44 \approx 91,4$$

$$SST = \sum (y_i - \bar{y})^2 = (47,74 - 51,2)^2 + (30,07 - 51,2)^2 + (24,51 - 51,2)^2 + (49,01 - 51,2)^2 + (44,17 - 51,2)^2 + (51,14 - 51,2)^2$$

$$SST = (-3,4)^2 + (-21,2)^2 + (3,4)^2 + (1,9)^2 + (13)^2 + (-9,4)^2$$

$$SST = 12,48 + 449,44 + 11,56 + 32,41 + 149 + 18,36 = 1201,02$$

$$T = 1 - \frac{SSR}{SST} = 1 - \frac{91,44}{1201,02} = 0,8702 \approx 0,87$$

$$1 - 0,87 = 0,13$$

درصد از بین آلودگی می بینم ۰,۱۳

(70)

Date: / /

Sat. Sun. Mon. Tue. Thu. Wed. Fri.

Subject: -----

منابع

به طور کلی بدی را به میان نرخ ارز و قیمت نفت نشان می دهد که این دو متغیر به نسبت بر دینار

اثر گذاشته و تغییرات هر کدام می تواند ساختار اقتصادی کشور را تحت تأثیر قرار دهد

منابع

نرخ ارز به ضریب دیناری نسبی

" = دینای اقتصاد

" " = اقتصاد ایران و جهان

نرخ نفت

منابع EIA U.S. Energy Information داد کارنی معتد نفت دولت رفشری کند

" Investing.Com داد مستقیم مقدار دینای نفت

منابع بلومبرگ bloomberg

" روتیز

" EIA و Investing