

عنوان مقاله:

ارزیابی تاثیر سرریز نوسانات ذخایر ارزی بانک مرکزی ایران بر نرخ تورم کاربرد مدل MGARCH-BEEK

محل انتشار:

چهارمین کنفرانس ملی پژوهش در حسابداری و مدیریت (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 15

نویسندگان:

عبدالامیر کاظمی زاده - دانشجوی دوره ی دکتری دانشگاه آزاد اسلامی واحد الیگودرز

داریوش حسونند - استادیار اقتصاد دانشکده اقتصاد لرستان و مدرس دانشگاه آزاد اسلامی الیگودرز

سید پرویز جلیلی کامجو - استادیار اقتصاد دانشگاه آیت ا... بروجردی و مدرس دانشگاه آزاد اسلامی الیگودرز

فرهاد ترحمی - استاد یار، پژوهشگر پسا دکتری علوم اقتصادی دانشگاه الزهرا

خلاصه مقاله:

نرخ تورم در ایران با نوسانات و بی ثباتی های قابل توجهی در چند دهه ی اخیر همراه بوده است که محققان زیادی به بررسی عوامل موثر بر نرخ تورم و بیثباتی آن پرداخته اند. بنابراین این مقاله به دنبال بررسی سرریز نوسانات ذخایر ارزی بانک مرکزی بر نوسانات نرخ تورم در اقتصاد ایران بوده است. بدین منظور سرریز بیثباتی نرخ تورم و ذخایر ارزی بانک مرکزی با استفاده از روش MGARCH-BEEK چند متغیره و با استفاده از داده های فصلی از فصل اول سال 1352 تا فصل چهارم سال 1395 برآورد شد. نتایج حاکی از آن بود که شوکها و نوسانات دوره قبل نرخ تورم تاثیر مستقیم و معنادار بر نوسانات نرخ تورم دوره جاری داشت. همچنین نتایج نشان داد که شوکهای دوره قبل ذخایر ارزی بانک مرکزی تاثیر مستقیم و معنادار بر نوسانات نرخ تورم دارد. بدین معنی که سرریز نوسانات ذخایر ارزی بر نرخ تورم در اقتصاد ایران روی داده است و شوکهای ناشی از ذخایر ارزی منجر به نااطمینانی و تلاطم نرخ تورم در ایران میشود.

کلمات کلیدی:

نرخ تورم، نوسانات نرخ تورم، ذخایر ارزی، MGARCH-BEEK

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1036542>

