

عنوان مقاله:

ارائه یک الگوی بهینه برای نگهداری ذخایر ارزی کشور در بانک مرکزی با استفاده از منطق فازی

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد و الگو سازی (اقتصاد سابق), دوره 1, شماره 3 (سال: 1389)

تعداد صفحات اصل مقاله: 28

نویسندگان:

محمدحسین پورکاظمی - گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد و علوم سیاسی، دانشگاه شهید بهشتی

محمدناصر شرافت جهرمی - گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد و علوم سیاسی، دانشگاه شهید بهشتی

فرشید غلامی - کارشناس ارشد دانشکده علوم اقتصادی و سیاسی دانشگاه شهید بهشتی

خلاصه مقاله:

ورود یورو به سیستم پولی بین المللی به عنوان یک رقیب جدی برای دلار و کاهش مستمر ارزش دلار در برابر یورو و سایر ارزها در چند سال اخیر، خساراتی را برای کشورهایی که دارای ذخایر عمدتاً دلاری بوده اند، در برداشته است. لذا پیش بینی اینکه نوسانات ارزهای خارجی به کدام سو متمایل اند و تعیین سبد ارزی بهینه، حائز اهمیت است. در این مقاله، با استفاده از روش فازی آریمما، نرخ برابری ریال ایران در برابر پنج ارز عمده یعنی دلار آمریکا، یورو، پوند انگلیس، ین ژاپن و فرانک سوئیس پیش بینی شده و با استفاده از رهیافت میانگین واریانس، ترکیب بهینه برای نگهداری ذخایر ارزی کشور در بانک مرکزی با داده های ماهانه ۱۳۸۱ لغایت ۱۳۸۵ به دست آمده است. نتایج تحقیق نشان می دهد که خطای پیش بینی روش فازی آریمما کمتر از خطای پیش بینی روش آریمماست و بنا به رهیافت میانگین واریانس، سهم دلار در ترکیب ذخایر ارزی کاهش، سهم یورو کمتر و سهم پوند بیشتر افزایش می یابد.

کلمات کلیدی:

سبد ارزی، پیش بینی، رگرسیون فازی، آریمما، فازی آریمما، رهیافت میانگین واریانس

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1301491>

