

عنوان مقاله:

تاثیر غیرخطی نااطمینانی نرخ ارز واقعی بر رشد اقتصادی با نفت و بدون نفت ایران: رهیافت GARCH-M

محل انتشار:

فصلنامه پژوهشنامه اقتصادی، دوره 14، شماره 55 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 30

نویسندگان:

مصطفی مبینی دهکردی - دانشجوی دکتری دانشگاه اصفهان

تیمور محمدی - دانشیار اقتصاد دانشگاه علامه طباطبائی

خلاصه مقاله:

طی سال های اخیر، محققان توجه فزاینده ای به رشد اقتصادی و عوامل موثر بر آن داشته اند. نرخ ارز و نوسانات ناشی از آن از جمله عوامل مهمی هستند که می توانند رشد اقتصادی هر کشور را تحت تاثیر قرار دهند. بررسی مطالعات مختلف در این زمینه حاکی از نتایج متناقضی در مورد تاثیرگذاری نوسانات این متغیر بر رشد اقتصادی است. با توجه به اهمیت این موضوع، هدف این مطالعه، بررسی تاثیر نااطمینانی نرخ ارز حقیقی بر رشد اقتصادی (با نفت و بدون نفت) در دوره ۱۳۶۹-۱۳۹۰ با استفاده از داده های فصلی به صورت غیرخطی است. در الگوی مطالعه، رشد اقتصادی تابعی از نااطمینانی نرخ ارز حقیقی، نرخ سرمایه گذاری، نرخ رشد سرمایه انسانی و نرخ رشد جمعیت فعال در نظر گرفته شده است. به منظور برآورد مقادیر نااطمینانی نرخ ارز حقیقی از مدل GARCH In Mean استفاده شده است. برای محاسبه سطح مشخصی از نااطمینانی نرخ ارز با استفاده از معیار حداقل انحراف معیار رگرسیون، برنامه ای در نرم افزار اجرا و سپس برای تشخیص اثر این نوسانات بر رشد اقتصادی از مدل GMM استفاده شده است. نتایج تحقیق حاکی از آن است که نااطمینانی نرخ ارز حقیقی تا سطح مشخصی که در این مطالعه محاسبه شده است، اثر منفی بر رشد اقتصادی (با نفت و بدون نفت) و بعد از آن اثر مثبت خواهد داشت.

کلمات کلیدی:

نرخ ارز حقیقی، رشد اقتصادی، نااطمینانی نرخ ارز حقیقی، مدل GARCH-M

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1407019>

